

# 红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券 投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>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	10
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、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>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（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>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	38
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	38

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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.12 投资组合报告附注 .....	39
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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 .....	40
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>40</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	43
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>44</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 .....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	44
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>44</b>
12.1 备查文件目录 .....	44
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	红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	红土创新沪深 300 增强	
基金主代码	006698	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 2 月 25 日	
基金管理人	红土创新基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	24,922,968.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	006698	006699
报告期末下属分级基金的份 额总额	16,304,232.86 份	8,618,735.65 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%、年跟踪误差不超过 7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上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。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		红土创新基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张洗尘	张燕
	联系电话	0755-33011878	0755-83199084
	电子邮箱	zhangxc@htcfund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		0755-33011866	95555
传真		0755-33011855	0755-83195201
注册地址		广东省深圳市前海深港合作区前	深圳市深南大道 7088 号招商银

	湾一路 1 号 A 栋 201 室	行大厦
办公地址	深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	阮菲	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htcxfund.com">http://www.htcxfund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	红土创新基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
本期已实现收益	1,700,841.86	1,289,581.94
本期利润	433,080.34	318,430.82
加权平均基金份额本期利润	0.0263	0.0311
本期加权平均净值利润率	1.64%	1.95%
本期基金份额净值增长率	1.37%	1.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	8,165,286.28	4,193,430.80
期末可供分配基金份额利润	0.5008	0.4865
期末基金资产净值	25,863,947.17	13,547,365.80
期末基金份额净值	1.5863	1.5719
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	58.63%	57.19%

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

沪深 300 增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.88%	0.72%	-1.91%	0.76%	-1.97%	-0.04%
过去三个月	2.16%	0.93%	3.34%	0.93%	-1.18%	0.00%
过去六个月	1.37%	1.22%	0.32%	1.25%	1.05%	-0.03%
过去一年	27.87%	1.26%	24.27%	1.27%	3.60%	-0.01%
自基金合同生效起至今	58.63%	1.24%	46.13%	1.28%	12.50%	-0.04%

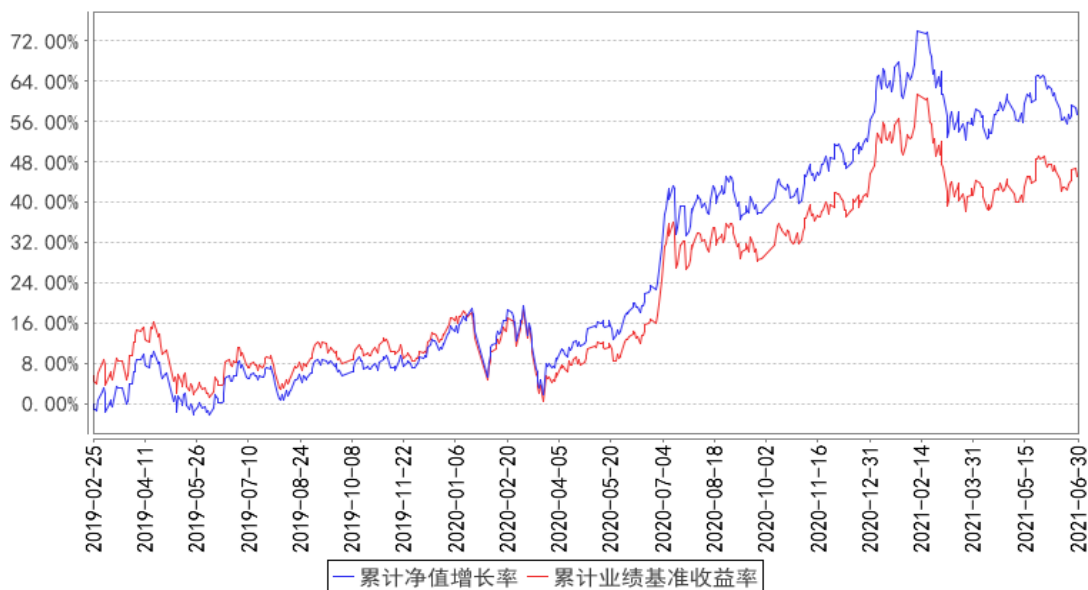
沪深 300 增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.91%	0.72%	-1.91%	0.76%	-2.00%	-0.04%
过去三个月	2.08%	0.93%	3.34%	0.93%	-1.26%	0.00%
过去六个月	1.23%	1.22%	0.32%	1.25%	0.91%	-0.03%

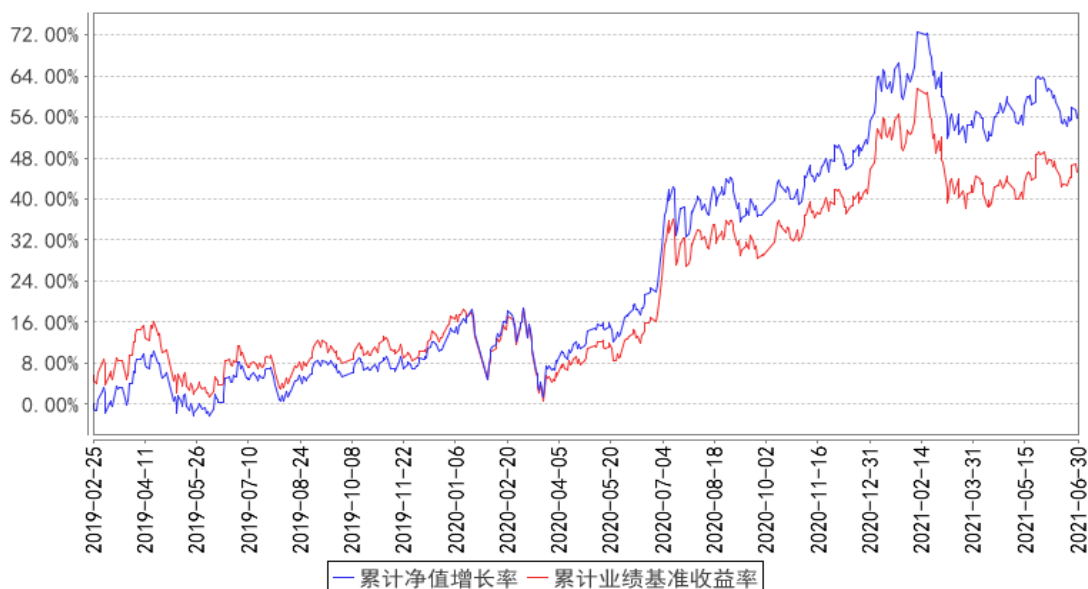
过去一年	27.49%	1.26%	24.27%	1.27%	3.22%	-0.01%
自基金合同生效起至今	57.19%	1.24%	46.13%	1.28%	11.06%	-0.04%

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

沪深300增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



沪深300增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 基金合同生效日至本报告期末已满一年。



## § 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 2021 年 6 月 30 日，红土创新基金共管理 14 只公募基金，资产管理规模 86.58 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		
储养	本基金的基金经理	2019 年 2 月 25 日	2021 年 08 月 10 日	7 年	中国人民大学经济学硕士，历任鹏华基金管理有限公司量化研究员，创金合信基金管理有限公司量化研究员、投资经理。曾任红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、红土创新中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
庞世恩	本基金的基金经理	2019 年 4 月 19 日	2021 年 07 月 07 日	6 年	中国人民大学理学硕士。曾任泰康资产管理有限责任公司金融工程研究总监、执行投资经理；创金合信基金管理有限公司量化投资部基金经理，管理过创金合信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、创金合信中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、创金合信量化多因子股票型证券投资基金、创金合信鑫回报灵活配置混合型证券投资基金、创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金。曾任红土创新基金管理有限公司量化投资部负责人，担任红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
李大玮	本基金的基金经理	2021 年 08 月 10 日	-	10 年	西南财经大学统计学硕士，曾任国泰安信息技术有限公司研究创新中心量化研究员；金瑞期货股份有限公司资产管理部量

					化研究员，量化投资策略研究负责人；中山证券有限责任公司财富管理部量化研究员，量化投资策略研究负责人；红土创新基金管理有限公司指数和量化投资部量化研究员。现任红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、红土创新中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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（2011 年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段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投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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

回顾 2021 年上半年，我们严格依据量化选股模型进行投资，并严格进行风险管理。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末沪深 300 增强 A 的基金份额净值为元，本报告期基金份额净值增长率为 1.37%，同期业绩比较基准收益率为 0.32%；截至本报告期末沪深 300 增强 C 的基金份额净值为元，本报告期基金份额净值增长率为 1.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.32%。截至本报告期末沪深 300 增强 A 的基金份额净值为元，本报告期基金份额净值增长率为 1.37%，同期业绩比较基准收益率为 0.32%；截至本报告期末沪深 300 增强 C 的基金份额净值为元，本报告期基金份额净值增长率为 1.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年，由于去年疫情导致经济大幅下滑，造成货币超发，以及经济开始逐渐回暖的背景下，大宗商品价格大幅上涨，全球处于通胀行情中。但由于经济仍处于触底回升阶段，整体流动性暂时也不会大幅收紧。在政府大力倡导房住不炒，提倡长期资金入市的背景下，我们对股市保持乐观预判，结构性行情机会大于大盘整体机会。在投资管理上，我们坚持严格采用量化模型进行投资运作。

#### 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，不适用本项说明。

### § 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

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不

存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	816,684.39	790,513.56
结算备付金		33,992.43	243,000.67
存出保证金		8,991.83	21,574.94
交易性金融资产	6.4.7.2	39,053,803.85	47,427,746.81
其中：股票投资		37,048,923.85	44,458,901.81
基金投资		-	-
债券投资		2,004,880.00	2,968,845.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		22,144.71	-
应收利息	6.4.7.5	35,432.01	57,582.04
应收股利		-	-
应收申购款		42,858.79	12,047.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		40,013,908.01	48,552,465.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	900,000.00
应付证券清算款		-	198,305.05
应付赎回款		286,177.57	25,380.78
应付管理人报酬		26,273.68	30,194.90
应付托管费		4,926.31	5,661.55
应付销售服务费		3,424.45	4,772.91
应付交易费用	6.4.7.7	22,153.83	82,838.47

应交税费		-	-
应付利息		-	400.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	259,639.20	250,005.38
负债合计		602,595.04	1,497,559.93
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	24,922,968.51	30,171,640.12
未分配利润	6.4.7.10	14,488,344.46	16,883,265.63
所有者权益合计		39,411,312.97	47,054,905.75
负债和所有者权益总计		40,013,908.01	48,552,465.68

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 24,922,968.51 份，其中沪深 300 增强 A 基金份额总额 16,304,232.86 份，基金份额净值 1.5863 人民币；沪深 300 增强 C 基金份额总额 8,618,735.65 份，基金份额净值 1.5719 人民币。

## 6.2 利润表

会计主体：红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,225,019.41	479,739.86
1. 利息收入		47,282.66	89,418.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,552.83	20,373.91
债券利息收入		44,729.83	69,045.02
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）		3,405,087.45	-428,072.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,064,360.37	-795,664.82
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-12,238.10	-29,120.02
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	352,965.18	396,712.37

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,238,912.64	751,142.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	11,561.94	67,251.17
减：二、费用		473,508.25	1,254,312.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	170,460.79	339,576.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	31,961.34	63,670.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	24,424.78	94,221.44
4. 交易费用	6.4.7.19	174,607.66	641,767.65
5. 利息支出		1,414.78	6,495.82
其中：卖出回购金融资产支出		1,414.78	6,495.82
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	70,638.90	108,580.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		751,511.16	-774,572.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		751,511.16	-774,572.23

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,171,640.12	16,883,265.63	47,054,905.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	751,511.16	751,511.16
三、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）	-5,248,671.61	-3,146,432.33	-8,395,103.94
其中：1. 基金申购款	3,010,016.61	1,808,099.68	4,818,116.29
2. 基金赎回款	-8,258,688.22	-4,954,532.01	-13,213,220.23
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	24,922,968.51	14,488,344.46	39,411,312.97

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	113,941,575.88	15,716,165.04	129,657,740.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-774,572.23	-774,572.23
三、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）	-79,659,029.12	-6,828,210.39	-86,487,239.51
其中：1. 基金申购款	82,450,196.61	11,594,099.32	94,044,295.93
2. 基金赎回款	-162,109,225.73	-18,422,309.71	-180,531,535.44
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	34,282,546.76	8,113,382.42	42,395,929.18

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：

阮菲

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

红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会 2018 年 11 月 9 日证监许可[2018]1828 号文核准,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《红土创新沪深 300 指数增强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 12,759,006.28 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(2019)第 0117 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金合同》于 2019 年 2 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 12,759,006.28 份基金份额。本基金的基金管理人为红土创新基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上

市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款和其他存款）、同业存单、权证、股指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（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times 95\%$ +一年期人民币定期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新新科技股票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

本报告期所采用的会计政策、会计估计及变更与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36



号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	816,684.39
定期存款	-
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	-
合计	816,684.39

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	36,637,006.98	37,048,923.85	411,916.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,030,880.00	2,004,880.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,030,880.00	2,004,880.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	38,667,886.98	39,053,803.85	385,916.87

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	77.53
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	13.40
应收债券利息	35,336.98
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	4.10
合计	35,432.01

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	22,153.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	22,153.83

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	48.82
应付证券出借违约金	-
预提费用	259,590.38
合计	259,639.20

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 沪深 300 增强 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	17,097,884.56	17,097,884.56
本期申购	1,290,892.44	1,290,892.44
本期赎回(以“-”号填列)	-2,084,544.14	-2,084,544.14
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	16,304,232.86	16,304,232.86

## 沪深 300 增强 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,073,755.56	13,073,755.56
本期申购	1,719,124.17	1,719,124.17
本期赎回(以“-”号填列)	-6,174,144.08	-6,174,144.08
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	8,618,735.65	8,618,735.65
-----	--------------	--------------

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

##### 沪深 300 增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,831,617.10	2,824,467.34	9,656,084.44
本期利润	1,700,841.86	-1,267,761.52	433,080.34
本期基金份额交易产生的变动数	-367,172.68	-162,277.79	-529,450.47
其中：基金申购款	627,153.16	162,665.21	789,818.37
基金赎回款	-994,325.84	-324,943.00	-1,319,268.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,165,286.28	1,394,428.03	9,559,714.31

##### 沪深 300 增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,078,648.38	2,148,532.81	7,227,181.19
本期利润	1,289,581.94	-971,151.12	318,430.82
本期基金份额交易产生的变动数	-2,174,799.52	-442,182.34	-2,616,981.86
其中：基金申购款	840,214.52	178,066.79	1,018,281.31
基金赎回款	-3,015,014.04	-620,249.13	-3,635,263.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,193,430.80	735,199.35	4,928,630.15

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	1,300.00
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	1,152.36
其他	100.47
合计	2,552.83

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	3,064,360.37
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	3,064,360.37

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	97,848,209.92
减：卖出股票成本总额	94,783,849.55
买卖股票差价收入	3,064,360.37

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-12,238.10
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	-12,238.10

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,786,667.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,763,108.10
减：应收利息总额	35,797.28
买卖债券差价收入	-12,238.10

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	352,965.18
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	352,965.18

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,238,912.64
股票投资	-2,234,775.74
债券投资	-4,136.90
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	-2,238,912.64

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	11,546.41
基金转换费收入	15.53
合计	11,561.94

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	174,607.66
银行间市场交易费用	-
合计	174,607.66

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
指数使用费	20,000.00
银行划款手续费	1,048.52
合计	70,638.90

**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、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
深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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	170,460.79	339,576.24
其中：支付销售机构的客户维护费	29,480.01	51,196.02

注：支付基金管理人红土创新的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	31,961.34	63,670.58

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C	合计
红土创新	-	19,252.84	19,252.84
合计	-	19,252.84	19,252.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C	合计
红土创新	-	67,283.80	67,283.80
合计	-	67,283.80	67,283.80



注：支付基金管理人红土创新的 C 类销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日 C 类销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2019 年 2 月 25 日）持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.00
报告期初持有的基金份额	14,545,538.21	5,000,400.00
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	14,545,538.21	5,000,400.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	89.2100%	58.0200%
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2019 年 2 月 25 日）持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.00
报告期初持有的基金份额	5,000,400.08	5,000,400.00
报告期间申购/买入总份额	9,545,138.13	-
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	14,545,538.21	5,000,400.00

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	88.4500%	28.0300%
-------------------------	----------	----------

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	816,684.39	1,300.00	1,413,240.73	14,974.82

#### 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(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	262	8,268.72	8,268.72	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资(主要是指数成份股、备选成份股)、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

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中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	816,684.39	-	-	-	816,684.39
结算备付金	33,992.43	-	-	-	33,992.43
存出保证金	8,991.83	-	-	-	8,991.83
交易性金融资产	2,004,880.00	-	-	37,048,923.85	39,053,803.85
应收利息	-	-	-	35,432.01	35,432.01
应收申购款	-	-	-	42,858.79	42,858.79
应收证券清算款	-	-	-	22,144.71	22,144.71
<b>资产总计</b>	<b>2,864,548.65</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>37,149,359.36</b>	<b>40,013,908.01</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	286,177.57	286,177.57
应付管理人报酬	-	-	-	26,273.68	26,273.68
应付托管费	-	-	-	4,926.31	4,926.31
应付销售服务费	-	-	-	3,424.45	3,424.45
应付交易费用	-	-	-	22,153.83	22,153.83
其他负债	-	-	-	259,639.20	259,639.20
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>602,595.04</b>	<b>602,595.04</b>
利率敏感度缺口	2,864,548.65	-	-	36,546,764.32	39,411,312.97

上年度末 2020 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	790,513.56	-	-	-	790,513.56
结算备付金	243,000.67	-	-	-	243,000.67
存出保证金	21,574.94	-	-	-	21,574.94
交易性金融资产	2,968,845.00	-	-	44,458,901.81	47,427,746.81
应收利息	-	-	-	57,582.04	57,582.04
应收申购款	-	-	-	12,047.66	12,047.66
资产总计	4,023,934.17	-	-	44,528,531.51	48,552,465.68
负债					
卖出回购金融资产款	900,000.00	-	-	-	900,000.00
应付证券清算款	-	-	-	198,305.05	198,305.05
应付赎回款	-	-	-	25,380.78	25,380.78
应付管理人报酬	-	-	-	30,194.90	30,194.90
应付托管费	-	-	-	5,661.55	5,661.55
应付销售服务费	-	-	-	4,772.91	4,772.91
应付交易费用	-	-	-	82,838.47	82,838.47
应付利息	-	-	-	400.89	400.89
其他负债	-	-	-	250,005.38	250,005.38
负债总计	900,000.00	-	-	597,559.93	1,497,559.93
利率敏感度缺口	3,123,934.17	-	-	43,930,971.58	47,054,905.75

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

#### 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。本基金股票资产占基金资产的比为 90%~95%。其中，本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的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不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	37,048,923.85	94.01	44,458,901.81	94.48
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	37,048,923.85	94.01	44,458,901.81	94.48

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	196.97	223.50
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-196.97	-223.50

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 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。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为 37,040,655.13 元，第二层次的余额为 2,013,148.72 元，无属于第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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。

###### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	37,048,923.85	92.59
	其中：股票	37,048,923.85	92.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,004,880.00	5.01
	其中：债券	2,004,880.00	5.01
	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	850,676.82	2.13
8	其他各项资产	109,427.34	0.27
9	合计	40,013,908.01	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	716,062.00	1.82
C	制造业	19,141,711.20	48.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,344.00	0.11
E	建筑业	431,683.00	1.10
F	批发和零售业	1,080,587.00	2.74
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	1,486,760.00	3.77
J	金融业	9,417,724.20	23.90
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,289,318.00	5.81
M	科学研究和技术服务业	93,954.00	0.24
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	1,070,459.00	2.72
R	文化、体育和娱乐业	1,232,956.00	3.13
S	综合	-	-
	合计	37,004,558.40	93.89

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	25,734.25	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,028.08	0.01
E	建筑业	8,268.72	0.02
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	7,334.40	0.02
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	-	-
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	44,365.45	0.11

### 7.2.3 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

#### 7.3.1 期末指数投资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	000001	平安银行	93,000	2,103,660.00	5.34
2	600519	贵州茅台	1,000	2,056,700.00	5.22
3	000725	京东方 A	310,700	1,938,768.00	4.92
4	600809	山西汾酒	3,900	1,747,200.00	4.43
5	002142	宁波银行	42,000	1,636,740.00	4.15
6	600309	万华化学	14,300	1,556,126.00	3.95
7	002230	科大讯飞	22,000	1,486,760.00	3.77
8	002027	分众传媒	150,800	1,419,028.00	3.60
9	000100	TCL 科技	177,900	1,360,935.00	3.45
10	601211	国泰君安	73,300	1,256,362.00	3.19
11	300413	芒果超媒	16,500	1,131,900.00	2.87
12	002179	中航光电	13,900	1,098,378.00	2.79
13	600426	华鲁恒升	35,000	1,083,250.00	2.75

14	603882	金域医学	6,700	1,070,459.00	2.72
15	603659	璞泰来	7,600	1,038,160.00	2.63
16	601318	中国平安	15,900	1,022,052.00	2.59
17	601377	兴业证券	101,900	984,354.00	2.50
18	600989	宝丰能源	71,400	976,752.00	2.48
19	601607	上海医药	45,600	963,528.00	2.44
20	601398	工商银行	177,500	917,675.00	2.33
21	601888	中国中免	2,900	870,290.00	2.21
22	601336	新华保险	17,900	821,789.00	2.09
23	000858	五粮液	2,400	714,936.00	1.81
24	603806	福斯特	5,400	567,702.00	1.44
25	600585	海螺水泥	13,700	562,385.00	1.43
26	600031	三一重工	19,100	555,237.00	1.41
27	601166	兴业银行	24,600	505,530.00	1.28
28	600132	重庆啤酒	2,400	475,080.00	1.21
29	000661	长春高新	1,200	464,400.00	1.18
30	601186	中国铁建	58,100	431,683.00	1.10
31	600104	上汽集团	19,100	419,627.00	1.06
32	000157	中联重科	38,500	355,740.00	0.90
33	600143	金发科技	15,400	321,244.00	0.82
34	601857	中国石油	56,100	296,769.00	0.75
35	000333	美的集团	4,000	285,480.00	0.72
36	601012	隆基股份	3,080	273,627.20	0.69
37	600019	宝钢股份	34,100	260,524.00	0.66
38	601225	陕西煤业	18,900	223,965.00	0.57
39	600276	恒瑞医药	3,100	210,707.00	0.53
40	300124	汇川技术	2,650	196,789.00	0.50
41	600028	中国石化	44,800	195,328.00	0.50
42	300014	亿纬锂能	1,700	176,681.00	0.45
43	002415	海康威视	2,500	161,250.00	0.41
44	600655	豫园股份	10,100	117,059.00	0.30
45	002739	万达电影	6,400	101,056.00	0.26
46	603833	欧派家居	700	99,372.00	0.25
47	300059	东方财富	2,980	97,714.20	0.25
48	603259	药明康德	600	93,954.00	0.24
49	000651	格力电器	1,800	93,780.00	0.24
50	688036	传音控股	258	54,051.00	0.14
51	600900	长江电力	2,100	43,344.00	0.11
52	600705	中航产融	10,400	40,248.00	0.10
53	600887	伊利股份	1,000	36,830.00	0.09
54	601838	成都银行	2,500	31,600.00	0.08

## 7.3.2 期末积极投资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	001207	联科科技	477	15,793.47	0.04
2	001208	华菱线缆	1,286	9,940.78	0.03
3	605287	德才股份	262	8,268.72	0.02
4	603171	税友股份	382	7,334.40	0.02
5	605011	杭州热电	341	3,028.08	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	2,777,230.00	5.90
2	300146	汤臣倍健	2,632,242.00	5.59
3	601166	兴业银行	2,629,225.00	5.59
4	600887	伊利股份	2,292,851.00	4.87
5	000725	京东方 A	2,244,627.00	4.77
6	600519	贵州茅台	2,153,991.00	4.58
7	000100	TCL 科技	2,002,621.00	4.26
8	000333	美的集团	1,979,138.00	4.21
9	002726	龙大肉食	1,900,078.06	4.04
10	601398	工商银行	1,888,520.00	4.01
11	002027	分众传媒	1,766,940.00	3.76
12	002142	宁波银行	1,679,816.00	3.57
13	300413	芒果超媒	1,660,988.20	3.53
14	002230	科大讯飞	1,510,952.00	3.21
15	603288	海天味业	1,490,731.66	3.17
16	600309	万华化学	1,449,694.00	3.08
17	600809	山西汾酒	1,425,730.00	3.03
18	002839	张家港行	1,398,036.00	2.97
19	603301	振德医疗	1,326,151.00	2.82
20	000651	格力电器	1,307,140.00	2.78
21	002475	立讯精密	1,293,524.00	2.75
22	600585	海螺水泥	1,223,548.00	2.60
23	600031	三一重工	1,205,605.00	2.56
24	600426	华鲁恒升	1,172,211.40	2.49
25	600438	通威股份	1,157,126.00	2.46
26	300122	智飞生物	1,094,883.00	2.33
27	601318	中国平安	1,066,235.00	2.27
28	600989	宝丰能源	1,052,006.00	2.24

29	601377	兴业证券	1,046,026.00	2.22
30	002179	中航光电	1,023,486.00	2.18
31	603882	金城医学	1,020,619.48	2.17
32	603659	璞泰来	1,019,493.00	2.17
33	000157	中联重科	960,404.00	2.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	3,927,241.00	8.35
2	600887	伊利股份	3,812,908.00	8.10
3	000333	美的集团	3,219,073.02	6.84
4	002726	龙大肉食	2,741,504.00	5.83
5	300146	汤臣倍健	2,525,724.00	5.37
6	600438	通威股份	2,179,920.00	4.63
7	601318	中国平安	2,152,948.00	4.58
8	002475	立讯精密	1,997,423.28	4.24
9	300059	东方财富	1,948,790.00	4.14
10	600000	XD 浦发银	1,882,035.68	4.00
11	000568	泸州老窖	1,874,885.00	3.98
12	002352	顺丰控股	1,594,244.00	3.39
13	601899	紫金矿业	1,551,591.00	3.30
14	002714	牧原股份	1,518,730.20	3.23
15	300015	爱尔眼科	1,513,945.00	3.22
16	600031	三一重工	1,461,102.00	3.11
17	300122	智飞生物	1,437,035.00	3.05
18	002839	张家港行	1,411,266.70	3.00
19	603288	海天味业	1,401,973.00	2.98
20	601398	工商银行	1,364,326.00	2.90
21	300142	沃森生物	1,349,545.00	2.87
22	300124	汇川技术	1,227,500.00	2.61
23	603301	振德医疗	1,158,090.18	2.46
24	601988	中国银行	1,152,588.00	2.45
25	000725	京东方 A	1,144,827.00	2.43
26	000651	格力电器	1,136,889.00	2.42
27	600900	长江电力	1,124,673.00	2.39
28	600837	海通证券	1,089,493.00	2.32
29	002027	分众传媒	968,898.00	2.06
30	000786	北新建材	967,291.00	2.06

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	89,608,647.33
卖出股票收入（成交）总额	97,848,209.92

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,004,880.00	5.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,004,880.00	5.09

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21 国债(7)	12,000	1,202,400.00	3.05
2	019645	20 国债 15	8,000	802,480.00	2.04

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 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没有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	8,991.83
2	应收证券清算款	22,144.71
3	应收股利	-
4	应收利息	35,432.01
5	应收申购款	42,858.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	109,427.34

### 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

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
沪 深	449	36,312.32	14,545,538.21	89.21	1,758,694.65	10.79

300 增强 A						
沪深 300 增强 C	410	21,021.31	5,000,400.00	58.02	3,618,335.65	41.98
合计	826	30,173.09	19,545,938.21	78.43	5,377,030.30	21.57

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	沪深 300A	18,953.39	0.12
	沪深 300C	210.14	0.00
	合计	19,163.53	0.08

### 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	份额级别	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	沪深 300 增强 A	0~10
	沪深 300 增强 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	沪深 300 增强 A	-
	沪深 300 增强 C	-
	合计	-

### 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	19,545,938.21	78.43	10,000,800.08	78.38	36 个月
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	19,545,938.21	78.43	10,000,800.08	78.38	36 个月

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	沪深 300 增强 A	沪深 300 增强 C
----	-------------	-------------



基金合同生效日（2019 年 2 月 25 日）基金份额总额	6,836,918.08	5,923,030.54
本报告期期初基金份额总额	17,097,884.56	13,073,755.56
本报告期基金总申购份额	1,290,892.44	1,719,124.17
减：本报告期基金总赎回份额	2,084,544.14	6,174,144.08
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,304,232.86	8,618,735.65

## § 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

2021 年 4 月 29 日，经本公司董事会决议通过并经中国证监会核准，任命冀洪涛先生担任本公司总经理，公司董事长阮菲女士不再代为行使总经理职责。2021 年 4 月 30 日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

2021 年 4 月 29 日，经公司第二届董事会第十六次会议决议通过，同意程志田先生于 2021 年 5 月 7 日辞去副总经理职务。2021 年 5 月 7 日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

2021 年 5 月 21 日，经工商行政管理部门核准，红土创新基金管理有限公司法定代表人变更为阮菲女士。2021 年 5 月 26 日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》。

2021 年 7 月 9 日，公司在《证券时报》上刊登了《红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告》，公告解聘庞世恩先生的本基金基金经理职务。

2021 年 8 月 11 日，公司在《证券时报》上刊登了《红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告》，公告增聘李大玮先生为本基金基金经理，解聘储莽女士本基金基金经理职务；现李大玮先生为本基金唯一基金经理。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	96,236,040.06	51.47%	31,903.77	53.03%	-
中银国际证券	1	90,741,799.75	48.53%	28,254.45	46.97%	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
华金证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

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

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

**A: 选择标准**

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

**B: 选择流程**

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

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

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券	2,554,150.00	100.00%	2,000,000.00	100.00%	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
华金证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

**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终止部分基金销售公司办理本公司旗下基金销售业务的提示	证券时报、公司网站	2021年01月22日
2	红土创新基金管理有限公司关于旗下两只基金修订基金合同、托管协议并更新招募说明书、产品资料概要的提示性公告	证券时报、公司网站	2021年03月31日
3	红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2021年04月30日
4	红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2021年05月07日
5	红土创新基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证券时报、公司网站	2021年05月26日

6	红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、公司网站	2021 年 07 月 09 日
7	红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、公司网站	2021 年 08 月 11 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20210630	19,545,938.21	-	-	19,545,938.21	78.43

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

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

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

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

##### 2. 流动性风险

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件
- (2) 红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- (3) 红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议
- (4) 红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(6) 报告期内红土创新沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼

## 12.3 查阅方式

公司网站: [www.htcxfund.com](http://www.htcxfund.com)

红土创新基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日