

# 红土创新新科技股票型发起式证券投资基金

## 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 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。

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 2021 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	红土创新新科技股票
基金主代码	006265
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 9 月 14 日
报告期末基金份额总额	95,038,336.61 份
投资目标	本基金主要投资于新科技产业主题的上市公司股票，在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，实现长期稳健增值。
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证 TMT 产业主题指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。
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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）
--------	-------------------------------------

1. 本期已实现收益	67,737,290.50
2. 本期利润	37,817,786.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3983
4. 期末基金资产净值	395,297,862.77
5. 期末基金份额净值	4.1594

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）扣除相关费用后得余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2、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。

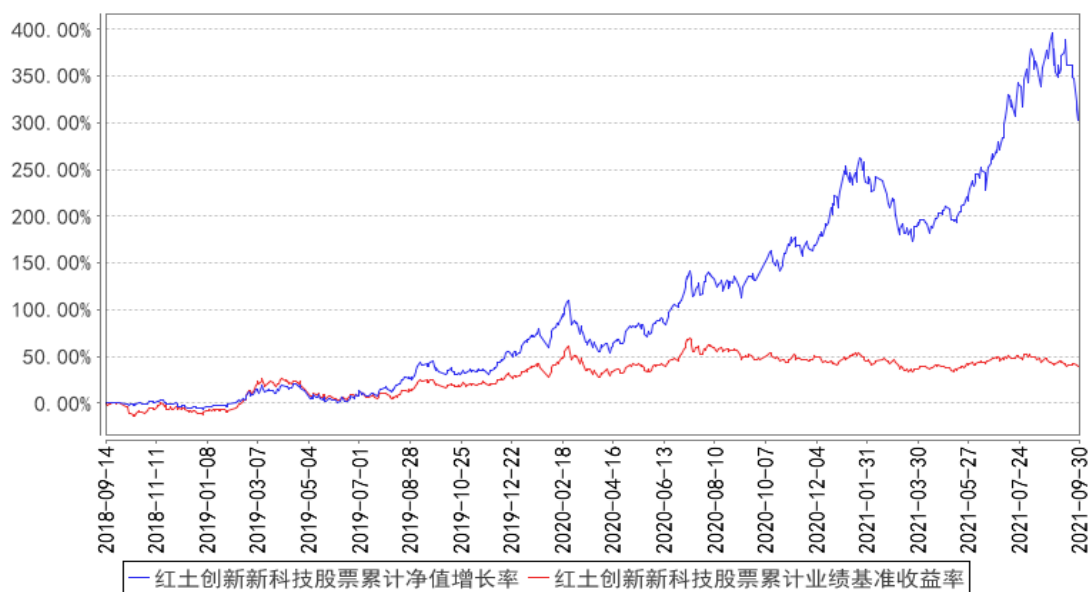
### 3.2 基金净值表现

#### 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	净值增长率 ①	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	11.03%	2.82%	-6.59%	1.03%	17.62%	1.79%
过去六个月	45.35%	2.35%	2.35%	0.99%	43.00%	1.36%
过去一年	76.18%	2.31%	-4.91%	1.04%	81.09%	1.27%
过去三年	321.92%	2.06%	40.15%	1.47%	281.77%	0.59%
自基金合同 生效起至今	322.13%	2.04%	40.05%	1.47%	282.08%	0.57%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石炯	本基金的基金经理	2021年8月3日	-	7年	暨南大学金融学硕士，6年证券从业经验。曾任中国中投证券机械行业研究员，东吴证券机械军工行业研究员，红土创新基金智能制造行业研究员，现任红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金经理。
朱然	本基金的基金经理	2018年9月14日	2021年8月3日	7年	北京大学硕士，曾在英特尔，甲骨文等高科技公司任职；历任广发证券（香港）海外市场分析师；本公司TMT行业高级研究员；曾任红土创新转型精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、红土创新新科技股票型发起式证券投资基金、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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 3 季度，上证综指下跌 0.64%，创业板指数下跌 6.7%，沪深 300 指数下跌 6.9%；市场风格方面，中小盘成长仍较强，大盘成长及价值较弱；Q3 涨幅居前的行业板块为煤炭、有色、钢铁、公用事业、化工、电新等，食品饮料、医药、消费者服务跌幅较大。新科技基金 Q3 涨幅 11.03%。

展望 4 季度，美联储 Taper 在市场预期之内，中国经济仍在下行通道、国内流动性仍处宽松水平。我们仍看好市场的结构性机会，方向上看好与经济周期弱相关、产业趋势高景气的硬科技赛道：新能源车、光伏、储能、高端制造、医药等方向。

9 月以来新能源产业链回调较多，我们认为回调更多归因于市场风格及交易层面因素、及市场对限电限产事件过度恐慌，而限电限产问题目前已经逐步边际改善、同时产业基本面实际上仍在超预期上行（如 9 月在缺芯环境下中国新能源车仍实现超预期的 35 万辆高成长的产销量，Q4 缺芯逐步缓解后产销量仍将环比上行），回调后的产业链 PEG 估值性价比进一步提升，我们相信产业链优质公司中长期仍将逐步创新高。

## 4.5 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 4.1594 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.03%，业

绩比较基准收益率为-6.59%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，自本基金合同生效之日起至报告期末本基金合同生效未满三年，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，基金管理人不对本基金持有人数及基金资产净值进行监控。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	375,405,207.86	90.07
	其中：股票	375,405,207.86	90.07
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	30,155,305.79	7.24
8	其他资产	11,213,916.97	2.69
9	合计	416,774,430.62	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末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	13,858,600.00	3.51
C	制造业	360,138,649.32	91.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,916.20	0.02
E	建筑业	18,114.41	0.00
F	批发和零售业	194,627.90	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	36,013.42	0.01
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	237,233.16	0.06

J	金融业	112,849.20	0.03
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	356,345.43	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	115,176.30	0.03
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	36,649.08	0.01
S	综合	191,800.00	0.05
	合计	375,405,207.86	94.97

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300037	新宙邦	259,800	40,269,000.00	10.19
2	002466	天齐锂业	357,700	36,335,166.00	9.19
3	603338	浙江鼎力	439,923	31,014,571.50	7.85
4	605117	德业股份	90,200	20,276,960.00	5.13
5	300274	阳光电源	125,900	18,681,042.00	4.73
6	002709	天赐材料	116,050	17,653,526.00	4.47
7	300763	锦浪科技	72,100	17,448,200.00	4.41
8	300390	天华超净	149,000	15,995,150.00	4.05
9	002139	拓邦股份	1,140,351	15,805,264.86	4.00
10	600110	诺德股份	708,900	15,177,549.00	3.84

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

### 5.5 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.5.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 5.5.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险，如预期

大额申购赎回、大量分红等。

## 5.6 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.6.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 5.6.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.6.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.7 投资组合报告附注

### 5.7.1 本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。

### 5.7.2 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。

### 5.7.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	308,549.19
2	应收证券清算款	5,465,784.53
3	应收股利	-
4	应收利息	4,727.18
5	应收申购款	5,434,856.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,213,916.97

### 5.7.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。



## 5.7.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情 况说明
1	002139	拓邦股份	15,805,264.86	4.00	非公开发行 流通受限

## 5.7.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	100,158,935.07
报告期期间基金总申购份额	84,776,753.79
减：报告期期间基金总赎回份额	89,897,352.25
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	95,038,336.61

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本 基金份额	16,026,624.77
报告期期间买入/申购总份 额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份 额	6,027,124.77
报告期期末管理人持有的本 基金份额	9,999,500.00
报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例 (%)	10.52

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	20210705	6,027,124.77	22,114,726.21	0.00000000
合计			6,027,124.77	22,114,726.21	

## § 8 报告期末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	9,999,500.00	10.52	9,999,500.00	10.52	三年
基金管理人高 级管理人员	25,103.38	0.03	4,945.98	0.01	三年
基金经理等人 员	-	-	-	-	-
基金管理人股 东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,024,603.38	10.55	10,004,445.98	10.53	三年

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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 (%)
无	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>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,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;</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>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。</p>							

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准红土创新新科技股票型发起式证券投资基金设立的文件
- (2) 红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金合同
- (3) 红土创新新科技股票型发起式证券投资基金托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 报告期内红土创新新科技股票型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

### 10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 10.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人红土创新基金管理有限公司，客户服务电话：4000603333（免长途话费）

红土创新基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日