

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 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43

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.....	43
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.....	43
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.....	44
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.....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	错误！未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	错误！未定义书签。
7.12 投资组合报告附注.....	44
§ 8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4 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.....	45
§ 9 开放式基金份额变动.....	45
§ 10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§ 12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	科创红土
场内简称	科创红土
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	235,445,468.54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	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资于通过战略配售取得的股票。本基金投资策略主要包括战略配售投资策略、股票投资策略和固定收益投资策略。
业绩比较基准	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*50%+中证全债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上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。本基金以投资战略配售股票为主要投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。

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@htcxfund.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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.htcxfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、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	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-42,993,835.28
本期利润	-10,061,167.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0427
本期加权平均净值利润率	-2.73%
本期基金份额净值增长率	-2.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	101,208,868.84
期末可供分配基金份额利润	0.4299
期末基金资产净值	371,835,505.24
期末基金份额净值	1.5793
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	57.93%

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

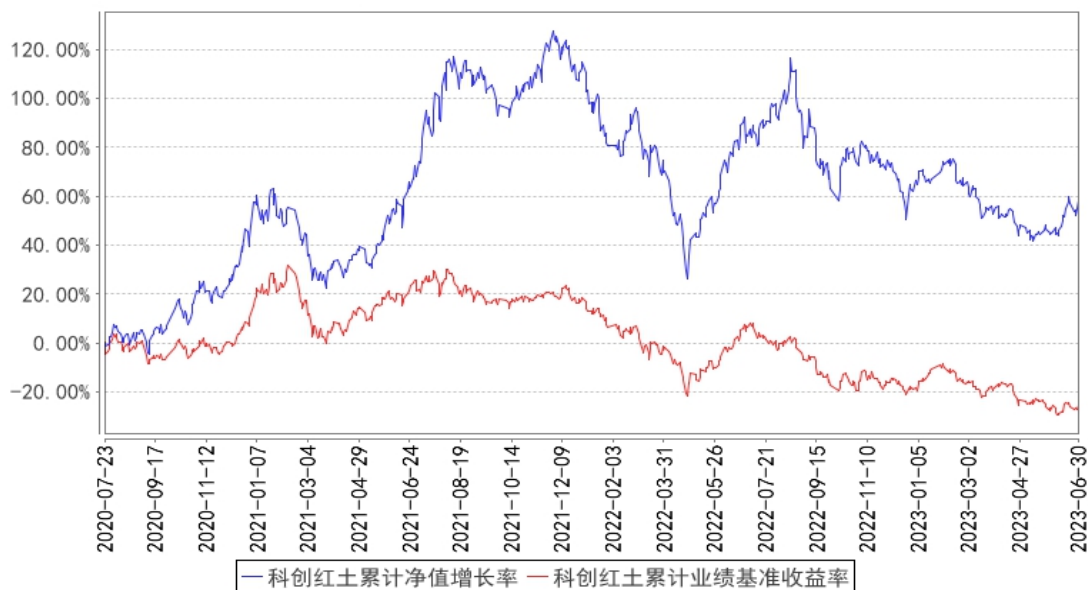
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	9.55%	1.39%	1.03%	0.67%	8.52%	0.72%
过去三个月	1.64%	1.29%	-4.24%	0.61%	5.88%	0.68%

过去六个月	-2.63%	1.27%	-3.71%	0.57%	1.08%	0.70%
过去一年	-14.61%	1.67%	-15.67%	0.66%	1.06%	1.01%
自基金合同生效起至今	57.93%	1.99%	-12.85%	0.80%	70.78%	1.19%

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

科创红土累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

红土创新基金管理有限公司（以下简称“红土创新基金”）经中国证监会证监许可【2014】562号文批准设立。红土创新基金总部位于深圳，注册资本为4亿元人民币，是国内首家创投系公募基金管理公司。公司股东为深圳市创新投资集团有限公司，持有股权100%。

红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上，借力股东对创业投资行业的深入理解，外加国内独创的博士后工作站研究支持，充分利用一级市场优势向二级市场延伸，将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至2023年6月30日，红土创新基金共管理22只公募基金，资产管理规模225.90亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		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 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金、红土创新新科技股票型发起式证券投资基金基金经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在不公平交易及异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基于看好光伏、储能等行业的长期成长性以及当下业绩的确定性，本基金 1 季度配置以新能源（光伏和储能）为主，以高端制造和 TMT 为辅。2 月份随着新能源负贝塔，调整的较多。2 季度配置以光伏、高端制造和 TMT 为主。本基金在光储板块的持仓都是自下而上精选的个股，目前判断新能源的行情已经在底部区域了，相信后续会有所表现。

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 1.5793 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.63%，业绩比较基准收益率为-3.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年投资者对经济的预期由强复苏逐步转变为弱复苏，因此顺周期相关板块表现一般，而 AI 相关主题板块涨幅可观。7 月 24 日政治局会议认为我国经济尽管面临新的困难挑战，但仍将曲折式前进，长期向好的基本面没有改变。会议的政策基调更加积极，强调要加大宏观政策调控力度，并指出了消费、房地产等产业政策的发力方向，对市场信心起到了切实的提振。目前已出台多项相关政策，例如地产相关（城中村改造、存量房贷利率调整），消费相关（汽车、家居、电子产品等大宗消费），企业减税降费，以及科技创新方向等政策。总体上，政策仍以提振信心，激发经济内生动力为主。我们认为目前投资者对国内外经济环境预期过于悲观，我们对中国经济的韧性和潜力抱有信心，预期未来市场存在较多的结构性投资机会。

对于 A 股市场，目前市场整体估值仍较低，下半年我们将从景气行业和经济复苏两个角度去关注下业绩兑现上较强的公司。景气行业重点关注能源体系发展趋势和人工智能领域。大国博弈和“碳中和”形势下，保障能源安全和重构能源结构将成为重要战略。在人工智能领域，预计 GPT 的应用、自动驾驶，以及人形机器人等方向都会有超预期的进展。总之，我们重点会在新能源、TMT、高端装备、消费等领域，着重结合公司的成长性和业绩兑现的确定性程度，以自下而上的角度精选科技创新类公司进行配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

额持有人产生不利影响。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金合同约定，本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,674,875.72	26,357,865.28
结算备付金		2,986,526.74	3,209,271.34
存出保证金		194,410.12	389,816.93
交易性金融资产	6.4.7.2	352,106,625.65	354,052,266.79

其中：股票投资		352,106,625.65	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		7,687,834.39	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		377,650,272.62	384,009,220.34
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,683,097.94	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		438,249.46	494,988.07
应付托管费		73,041.59	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	6.4.7.9	1,620,378.39	1,535,061.85
负债合计		5,814,767.38	2,112,547.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	235,445,468.54	235,445,468.54
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	136,390,036.70	146,451,203.87
净资产合计		371,835,505.24	381,896,672.41
负债和净资产总计		377,650,272.62	384,009,220.34

注：本基金合同生效日为2020年07月23日，本报告期自基金合同生效日2020年07月23日起至2023年06月30日止。报告截止日2023年06月30日，基金份额净值1.5793元，基金份额总额235,445,468.54份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023年 6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
一、营业总收入		-6,766,674.33	-66,875,891.74
1. 利息收入		61,310.18	88,417.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	61,310.18	88,417.07
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-39,760,652.62	-85,666,507.42
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-41,048,084.86	-87,016,187.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,287,432.24	1,349,679.89
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	32,932,668.11	18,702,198.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-

减：二、营业总支出		3,294,492.84	3,629,983.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,746,997.69	3,034,538.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	457,833.00	505,756.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	89,662.15	89,688.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,061,167.17	-70,505,875.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,061,167.17	-70,505,875.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-10,061,167.17	-70,505,875.28

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	235,445,468.54	-	146,451,203.87	381,896,672.41
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	235,445,468.54	-	146,451,203.87	381,896,672.41
三、本期增减变动额（减少	-	-	-10,061,167.17	-10,061,167.17

以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-10,061,167.17	-10,061,167.17
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
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基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	235,445,468.54	-	136,390,036.70	371,835,505.24
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	235,445,468.54	-	270,522,155.57	505,967,624.11

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产（基金净值）	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）	-	-	-70,505,875.28	-70,505,875.28
（一）、综合收益总额	-	-	-70,505,875.28	-70,505,875.28
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
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基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收	-	-	-	-

益结转留存收益				
四、本期末净资产（基金净值）	235,445,468.54	-	200,016,280.29	435,461,748.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]68 号《关于准予红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由红土创新基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型,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 235,291,739.71 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(2020)第 0514 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于 2020 年 7 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 235,445,468.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 153,728.83 份基金份额。本基金的基金管理人为红土创新基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》的相关规定,本基金在基金合同生效的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内,本基金不办理申购、赎回业务,但投资者可在其持有的基金份额上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。封闭运作期届满后,本基金将转为上市开放式基金(LOF),基金名称调整为“红土创新科技创新股票型证券投资基金(LOF)”,并接受场内、场外申购和赎回。

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 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围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、政策性

金融债、中央银行票据、信用等级在 AAA(含)以上的债券及非金融企业债务融资工具等)、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)。本基金封闭运作期内,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%;投资同业存单的比例不得超过基金资产的 20%。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×50%+中证全债指数收益率×50%。

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 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

除下述会计政策和会计估计外,本基金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。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

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或金融负债。

(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业务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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。

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。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为5,374,373.76元、3,813,585.14元、347,558.23元、2,954.15元和6,818,803.01元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为5,375,268.16元、3,815,472.85元、347,730.27元、0.00元和6,818,803.01元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为500,530,464.98元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为500,530,464.98元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为8,068,096.97元、652,743.16元、108,790.53元和1,910,484.50元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为8,068,096.97元、652,743.16元、108,790.53元和1,910,484.50元。

于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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

据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的

补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	14,674,875.72
等于：本金	14,673,418.09
加：应计利息	1,457.63
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限 1 个月以内	
存款期限 1-3 个月	
存款期限 3 个月以上	
其他存款	
等于：本金	
加：应计利息	
减：坏账准备	
合计	14,674,875.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	316,925,457.79	-	352,106,625.65	35,181,167.86
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	316,925,457.79	-	352,106,625.65	35,181,167.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,531,118.24
其中：交易所市场	1,531,118.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	1,620,378.39

6.4.7.7 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 6 月 30 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	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	235,445,468.54	235,445,468.54

注：申购含红利再投、级别调整入份额。赎回含级别调整出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

6.4.7.9 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
本期利润	-42,993,835.28	32,932,668.11	-10,061,167.17
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	101,208,868.84	35,181,167.86	136,390,036.70

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	17,049.85
其他	2,174.50
合计	61,310.18

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 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6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-41,048,084.86
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	-41,048,084.86

6.4.7.11.2 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6月30日
卖出股票成交总额	1,634,461,178.48
减：卖出股票成本总额	1,671,257,964.73
减：交易费用	4,251,298.61
买卖股票差价收入	-41,048,084.86

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,287,432.24
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	1,287,432.24

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	32,932,668.11
股票投资	32,932,668.11
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	32,932,668.11

6.4.7.15 其他收入

无。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	402.00
合计	89,662.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

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、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
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	基金管理人的控股股东

投”)	
-----	--

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,746,997.69	3,034,538.47
其中：支付销售机构的客户维护费	2,739,666.06	1,331,944.20

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	457,833.00	505,756.37

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：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

基金合同生效日（2020 年 7 月 23 日）持有的基金份额	20,004,500.00	-
报告期初持有的基金份额	-	20,004,500.00
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/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	8.50%	0.0000%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	14,674,875.72	42,085.83	36,667,210.50	60,177.69

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	受限期	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
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	创业板新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301260	格力	2023 年 1 月	6 个月	创业板新	30.85	23.63	824	25,420.40	19,471.12	-

	博	20 日	月	股锁定						
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个 月	创业板新 股锁定	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个 月	创业板新 股锁定	87.62	53.24	202	17,699.85	10,754.48	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个 月	创业板新 股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个 月	创业板新 股锁定	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-

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。

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，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于约定开放日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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上

上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,674,875.72	-	-	-	14,674,875.72
结算备付金	2,986,526.74	-	-	-	2,986,526.74
存出保证金	194,410.12	-	-	-	194,410.12
交易性金融资产	-	-	-	-352,106,625.65	352,106,625.65
应收清算款	-	-	-	7,687,834.39	7,687,834.39
资产总计	17,855,812.58	-	-	-359,794,460.04	377,650,272.62
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	438,249.46	438,249.46
应付托管费	-	-	-	73,041.59	73,041.59
应付清算款	-	-	-	3,683,097.94	3,683,097.94
其他负债	-	-	-	1,620,378.39	1,620,378.39
负债总计	-	-	-	5,814,767.38	5,814,767.38
利率敏感度缺口	17,855,812.58	-	-	-353,979,692.66	371,835,505.24
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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

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，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	352,106,625.65	94.69	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	352,106,625.65	94.69	354,052,266.79	92.71

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	1. 业绩比较基准上升5%	17,605,331.28	34,587,903.13

	2. 业绩比较基准 下降 5%	-17,605,331.28	-34,587,903.13
--	--------------------	----------------	----------------

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	352,026,577.07	351,933,606.86
第二层次	-	-
第三层次	80,048.58	2,118,659.93
合计	352,106,625.65	354,052,266.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	352,106,625.65	93.24
	其中：股票	352,106,625.65	93.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,661,402.46	4.68
8	其他各项资产	7,882,244.51	2.09
9	合计	377,650,272.62	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	99,185.23	0.03
C	制造业	298,115,961.44	80.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,152.56	0.00
E	建筑业	6,782,720.00	1.82
F	批发和零售业	7,719,763.85	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	13,196.70	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,182,520.33	6.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,968,962.70	1.61
M	科学研究和技术服务业	9,186,737.39	2.47
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	20,174.45	0.01
R	文化、体育和娱乐业	9,251.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	352,106,625.65	94.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	001223	欧克科技	395,401	35,977,536.99	9.68
2	301030	仕净科技	518,600	35,835,260.00	9.64
3	300130	新国都	856,100	24,253,313.00	6.52
4	603688	石英股份	205,400	23,382,736.00	6.29
5	300573	兴齐眼药	79,000	16,890,200.00	4.54
6	600537	亿晶光电	2,046,400	15,634,496.00	4.20
7	688668	鼎通科技	159,017	15,551,862.60	4.18
8	603516	淳中科技	571,300	12,597,165.00	3.39
9	603081	大丰实业	655,700	12,051,766.00	3.24
10	688036	传音控股	68,595	10,083,465.00	2.71
11	002315	焦点科技	234,180	9,367,200.00	2.52
12	300081	恒信东方	848,100	9,125,556.00	2.45
13	300842	帝科股份	98,800	9,034,272.00	2.43
14	600685	中船防务	298,200	8,931,090.00	2.40
15	688539	N 高华	190,660	8,846,624.00	2.38
16	300314	戴维医疗	391,200	8,269,968.00	2.22
17	688048	长光华芯	87,342	8,255,565.84	2.22
18	002236	大华股份	405,800	8,014,550.00	2.16
19	603108	润达医疗	407,300	7,567,634.00	2.04
20	300982	苏文电能	112,000	6,782,720.00	1.82
21	688579	山大地纬	400,324	6,597,339.52	1.77
22	603040	新坐标	238,500	6,341,715.00	1.71
23	300593	新雷能	274,360	6,285,587.60	1.69
24	605168	三人行	69,455	5,968,962.70	1.61
25	002917	金奥博	446,400	5,517,504.00	1.48
26	300510	金冠股份	715,700	4,995,586.00	1.34
27	301162	国能日新	56,480	4,455,142.40	1.20
28	002971	和远气体	162,000	4,155,300.00	1.12
29	688636	智明达	68,207	3,751,385.00	1.01
30	688503	聚和材料	37,125	3,619,687.50	0.97
31	688297	中无人机	70,031	3,591,889.99	0.97
32	688439	振华风光	32,667	3,587,489.94	0.96

33	600845	宝信软件	49,880	2,534,402.80	0.68
34	601633	长城汽车	71,000	1,787,070.00	0.48
35	688031	星环科技	7,913	1,054,328.12	0.28
36	688416	恒烁股份	2,147	168,539.50	0.05
37	301408	华人健康	8,784	152,129.85	0.04
38	688252	天德钰	5,201	105,528.29	0.03
39	688143	长盈通	2,519	94,966.30	0.03
40	301157	华塑科技	1,498	83,481.42	0.02
41	600925	N 苏能	8,960	55,283.20	0.01
42	001311	多利科技	649	37,272.07	0.01
43	301165	锐捷网络	504	31,106.88	0.01
44	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.01
45	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.01
46	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.01
47	301339	通行宝	913	22,943.69	0.01
48	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
49	301327	华宝新能	268	21,201.48	0.01
50	301366	一博科技	482	20,942.90	0.01
51	301322	绿通科技	373	20,356.13	0.01
52	301267	华夏眼科	331	20,174.45	0.01
53	301363	美好医疗	445	19,575.55	0.01
54	301260	格力博	824	19,471.12	0.01
55	601121	N 宝地	2,532	19,344.48	0.01
56	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
57	301377	鼎泰高科	770	17,710.00	0.00
58	301296	新巨丰	1,042	17,588.96	0.00
59	301152	天力锂能	366	16,345.56	0.00
60	301328	维峰电子	286	16,284.84	0.00
61	301389	隆扬电子	875	15,907.50	0.00
62	301396	宏景科技	475	15,508.75	0.00
63	301361	众智科技	517	14,574.23	0.00
64	301356	天振股份	652	14,278.80	0.00
65	301335	天元宠物	588	14,017.92	0.00
66	603162	N 海通发	774	13,196.70	0.00
67	603153	N 建科	740	13,135.00	0.00
68	301365	矩阵股份	774	12,740.04	0.00
69	301379	天山电子	449	12,540.57	0.00
70	301115	建科股份	545	12,458.70	0.00
71	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
72	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
73	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
74	301277	新天地	538	10,496.38	0.00
75	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00

76	001366	播恩集团	645	9,945.90	0.00
77	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
78	301176	逸豪新材	544	9,345.92	0.00
79	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
80	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
81	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
82	603065	N 宿迁	581	8,656.90	0.00
83	301326	捷邦科技	227	8,632.81	0.00
84	301349	信德新材	168	8,423.52	0.00
85	301359	东南电子	328	8,357.44	0.00
86	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
87	603291	N 联合	536	8,152.56	0.00
88	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
89	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
90	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
91	301276	嘉曼服饰	303	7,726.50	0.00
92	301309	万得凯	228	6,279.12	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002123	梦网科技	35,856,917.00	9.39
2	603688	石英股份	34,505,630.00	9.04
3	001223	欧克科技	34,370,250.09	9.00
4	300496	中科创达	30,767,510.33	8.06
5	300031	宝通科技	24,002,044.00	6.28
6	300510	金冠股份	21,861,038.03	5.72
7	603283	赛腾股份	21,201,100.00	5.55
8	300130	新国都	20,760,530.24	5.44
9	300842	帝科股份	20,664,127.00	5.41
10	002869	金溢科技	19,653,926.00	5.15
11	688390	固德威	18,820,715.41	4.93
12	300144	宋城演艺	18,621,763.60	4.88
13	002458	益生股份	17,988,033.55	4.71
14	688036	传音控股	17,933,574.10	4.70
15	002234	民和股份	17,840,317.00	4.67
16	002317	众生药业	17,681,555.00	4.63
17	600895	张江高科	17,568,177.76	4.60
18	688676	金盘科技	17,519,572.28	4.59
19	688383	新益昌	17,265,228.21	4.52
20	002129	TCL 中环	17,112,995.00	4.48
21	300573	兴齐眼药	17,105,088.00	4.48

22	002865	钧达股份	16,708,529.66	4.38
23	600685	中船防务	16,624,605.64	4.35
24	600475	华光环能	15,768,715.44	4.13
25	600415	小商品城	15,713,334.00	4.11
26	603212	赛伍技术	15,493,463.00	4.06
27	688598	金博股份	15,301,963.85	4.01
28	600537	亿晶光电	14,876,429.88	3.90
29	603081	大丰实业	14,821,039.00	3.88
30	605168	三人行	14,712,481.26	3.85
31	301322	绿通科技	13,984,705.52	3.66
32	600732	爱旭股份	13,724,785.00	3.59
33	300533	冰川网络	13,501,520.00	3.54
34	002368	太极股份	13,207,219.45	3.46
35	300360	炬华科技	13,055,845.00	3.42
36	002121	科陆电子	12,902,991.50	3.38
37	688668	鼎通科技	12,532,900.40	3.28
38	601882	海天精工	12,228,267.73	3.20
39	300314	戴维医疗	12,196,782.00	3.19
40	600197	伊力特	12,120,005.05	3.17
41	603516	淳中科技	12,064,927.00	3.16
42	300634	彩讯股份	11,769,335.00	3.08
43	002602	世纪华通	11,263,355.00	2.95
44	002607	中公教育	11,251,450.00	2.95
45	002864	盘龙药业	11,063,118.70	2.90
46	300614	百川畅银	11,029,227.00	2.89
47	688029	南微医学	10,763,880.74	2.82
48	600050	中国联通	10,685,912.84	2.80
49	688439	振华风光	10,482,067.95	2.74
50	600062	华润双鹤	10,306,889.00	2.70
51	000999	华润三九	10,287,032.00	2.69
52	603871	嘉友国际	10,247,020.12	2.68
53	600705	中航产融	10,202,072.00	2.67
54	002738	中矿资源	10,105,493.76	2.65
55	002315	焦点科技	10,038,150.60	2.63
56	300161	华中数控	9,938,553.00	2.60
57	603359	东珠生态	9,762,668.00	2.56
58	301030	仕净科技	9,301,167.00	2.44
59	300081	恒信东方	9,279,402.00	2.43
60	603258	电魂网络	9,275,573.00	2.43
61	300033	同花顺	9,237,089.00	2.42
62	002236	大华股份	9,220,694.00	2.41
63	002735	王子新材	9,066,385.52	2.37
64	300672	国科微	9,048,254.22	2.37

65	600853	龙建股份	8,971,623.60	2.35
66	300820	英杰电气	8,925,676.92	2.34
67	301179	泽宇智能	8,881,358.60	2.33
68	300438	鹏辉能源	8,874,179.00	2.32
69	600166	福田汽车	8,791,880.00	2.30
70	688305	科德数控	8,784,092.36	2.30
71	603040	新坐标	8,747,879.00	2.29
72	002946	新乳业	8,680,944.25	2.27
73	688111	金山办公	8,662,274.15	2.27
74	603773	沃格光电	8,584,184.20	2.25
75	600150	中国船舶	8,515,407.06	2.23
76	000860	顺鑫农业	8,431,119.20	2.21
77	688392	骄成超声	8,226,471.11	2.15
78	301162	国能日新	8,126,670.86	2.13
79	688539	N 高华	8,080,826.83	2.12
80	002409	雅克科技	7,958,757.00	2.08
81	002139	拓邦股份	7,820,790.00	2.05
82	301328	维峰电子	7,791,385.00	2.04
83	002446	盛路通信	7,776,997.00	2.04
84	688048	长光华芯	7,763,430.25	2.03
85	600389	江山股份	7,744,591.38	2.03

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	603688	石英股份	40,306,458.49	10.55
2	002458	益生股份	35,071,809.28	9.18
3	002123	梦网科技	33,289,819.00	8.72
4	002234	民和股份	31,070,798.55	8.14
5	603728	鸣志电器	29,726,673.88	7.78
6	002865	钧达股份	29,606,390.01	7.75
7	300496	中科创达	29,539,445.77	7.73
8	300438	鹏辉能源	24,829,927.00	6.50
9	300031	宝通科技	24,570,156.00	6.43
10	300672	国科微	21,649,531.94	5.67
11	300779	惠城环保	21,630,978.19	5.66
12	300693	盛弘股份	20,915,427.32	5.48
13	300533	冰川网络	20,175,124.27	5.28
14	603283	赛腾股份	19,739,601.75	5.17
15	301030	仕净科技	19,654,048.00	5.15
16	002869	金溢科技	19,258,832.00	5.04
17	003028	振邦智能	18,771,916.36	4.92
18	600895	张江高科	18,101,334.00	4.74

19	688630	芯碁微装	17,974,583.64	4.71
20	688383	新益昌	17,844,387.91	4.67
21	300144	宋城演艺	17,241,197.00	4.51
22	002317	众生药业	16,576,001.49	4.34
23	688390	固德威	16,257,536.14	4.26
24	600415	小商品城	16,109,610.00	4.22
25	688676	金盘科技	15,186,659.74	3.98
26	002129	TCL 中环	14,923,025.00	3.91
27	688598	金博股份	14,662,307.11	3.84
28	300510	金冠股份	14,369,432.00	3.76
29	600475	华光环能	14,240,581.78	3.73
30	002965	祥鑫科技	14,110,355.00	3.69
31	002602	世纪华通	13,916,013.00	3.64
32	002335	科华数据	13,899,094.84	3.64
33	300842	帝科股份	13,582,607.57	3.56
34	688663	新风光	13,371,881.27	3.50
35	600732	爱旭股份	13,121,063.90	3.44
36	300360	炬华科技	13,059,370.00	3.42
37	603212	赛伍技术	12,520,862.00	3.28
38	301322	绿通科技	12,431,179.82	3.26
39	300161	华中数控	12,266,328.00	3.21
40	600197	伊力特	11,950,312.00	3.13
41	300634	彩讯股份	11,930,420.00	3.12
42	002518	科士达	11,825,337.10	3.10
43	002992	宝明科技	11,754,260.00	3.08
44	300109	新开源	11,610,464.06	3.04
45	002368	太极股份	11,523,842.00	3.02
46	002864	盘龙药业	11,446,895.64	3.00
47	688103	国力股份	11,438,521.45	3.00
48	688029	南微医学	11,076,634.55	2.90
49	300614	百川畅银	11,075,260.50	2.90
50	603595	东尼电子	11,024,321.00	2.89
51	000999	华润三九	10,866,986.51	2.85
52	002607	中公教育	10,857,174.00	2.84
53	601882	海天精工	10,700,533.50	2.80
54	603773	沃格光电	10,655,047.00	2.79
55	600062	华润双鹤	10,411,175.85	2.73
56	605168	三人行	10,251,946.40	2.68
57	300629	新劲刚	10,207,846.96	2.67
58	002738	中矿资源	10,025,730.80	2.63
59	600050	中国联通	10,009,800.00	2.62
60	600166	福田汽车	10,004,382.00	2.62
61	002121	科陆电子	9,997,083.00	2.62

62	603308	应流股份	9,830,503.00	2.57
63	603359	东珠生态	9,790,184.00	2.56
64	600705	中航产融	9,679,224.00	2.53
65	300820	英杰电气	9,586,378.80	2.51
66	300033	同花顺	9,576,941.00	2.51
67	603258	电魂网络	9,519,176.79	2.49
68	300762	上海瀚讯	9,449,863.80	2.47
69	600853	龙建股份	9,326,529.00	2.44
70	688036	传音控股	8,928,352.73	2.34
71	688111	金山办公	8,892,549.67	2.33
72	603871	嘉友国际	8,660,629.28	2.27
73	301179	泽宇智能	8,631,184.80	2.26
74	002946	新乳业	8,579,176.80	2.25
75	300571	平治信息	8,474,245.00	2.22
76	002409	雅克科技	8,189,272.00	2.14
77	600150	中国船舶	8,022,759.00	2.10
78	002139	拓邦股份	7,987,962.00	2.09
79	688305	科德数控	7,948,343.67	2.08
80	002735	王子新材	7,864,330.00	2.06
81	301328	维峰电子	7,848,548.00	2.06
82	688392	骄成超声	7,758,710.13	2.03
83	600685	中船防务	7,700,914.97	2.02
84	300068	南都电源	7,661,553.35	2.01

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	1,636,379,655.48
卖出股票收入（成交）总额	1,634,461,178.48

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.10.2 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。

7.10.3 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	194,410.12
2	应收清算款	7,687,834.39
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,882,244.51

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。

7.10.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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 (%)
5,295	44,465.62	20,070,000.00	8.52	215,375,468.54	91.48

8.2 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	20004500.00	8.50
2	熊海涛	7154647.58	3.04
3	吴宇婷	3467854.37	1.47
4	张恩光	2989802.81	1.27
5	王喜艳	2989529.63	1.27
6	余诗慧	2986523.24	1.27
7	余卫华	1992571.87	0.85
8	邝立群	1992481.87	0.85
9	叶树明	1992481.87	0.85
10	郭东荣	1992481.87	0.85

8.3 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	200,194.81	0.09

8.4 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、基金投资和研发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

§ 9 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	-
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	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	235,445,468.54

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华创证券	2	994,282,260.79	30.41	717,177.42	30.41	-
天风证券	1	457,578,891.95	14.00	330,053.00	14.00	-
海通证券	1	439,072,518.50	13.43	316,703.48	13.43	-
国盛证券	1	383,516,634.85	11.73	276,626.05	11.73	-
浙商证券	1	220,821,912.75	6.75	159,279.38	6.75	-

中泰证券	1	160,089,643.34	4.90	115,480.54	4.90	-
中信建投证券	2	147,446,379.57	4.51	106,353.37	4.51	-
申港证券	2	143,086,917.80	4.38	103,202.98	4.38	-
平安证券	1	139,853,174.58	4.28	100,879.36	4.28	-
长江证券	1	90,818,450.46	2.78	65,507.41	2.78	-
东方财富	2	58,503,574.26	1.79	42,196.19	1.79	-
广发证券	2	34,405,975.24	1.05	24,816.26	1.05	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

国盛证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
华林证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	红土创新基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京雪球基金销售有	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本	2023 年 3 月 21 日

	限公司申购起点金额的公告	公司网站	
2	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 21 日
3	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 27 日
4	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 10 日
5	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金在国信证券暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 25 日
6	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金财富为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 2 日
7	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新兰德为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 14 日
8	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 19 日
9	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长江证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 26 日
10	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 27 日
11	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰期货为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况
无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金合同约定，本基金的封闭运作期于 2023 年 7 月 23 日届满，本基金自 2023 年 7 月 24 日起自动转为上市开放式基金（LOF），并接受场外、场内申购赎回，基金名称将变更为“红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）”。

§ 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科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;
- (2) 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;
- (3) 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托管协议;
- (4) 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3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

公司网站：www.htcxfund.com

红土创新基金管理有限公司

2023年8月31日