
红塔红土盛利混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人：红塔红土基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2022 年 08 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、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的法律责任。本中期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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 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	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55
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	55

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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红塔红土盛利混合型证券投资基金	
基金简称	红塔红土盛利混合	
基金主代码	012216	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 08 月 02 日	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	259,265,220.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C
下属分级基金的交易代码	012216	012217
报告期末下属分级基金的份额总额	236,376,845.06 份	22,888,375.08 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将在严格控制投资组合风险的前提下，寻找有持续增长潜力且相对被市场低估的个券，优化投资组合，力求实现持续稳健的资产增值。
投资策略	本基金为混合型基金，投资策略细分为大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+中债总指数（财富）收益率×45%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		红塔红土基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	龚香林	田东辉
	联系电话	0755-33372133	010-68858113
	电子邮箱	htservice@htamc.com.cn	tiaidonghui@psbc.com
客户服务电话		4001-666-916（免长途话费）	95580
传真		0755-33379015	010-68858120
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区金融大街 3 号

办公地址	深圳市南山区侨香路 4068 号智慧广场 A 栋 801	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	518053	100808
法定代表人	龚香林	刘建军

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	http://www.htamc.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和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	红塔红土基金管理有限公司	深圳市南山区侨香路 4068 号智慧广场 A 栋 801

§ 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(2022年01月01日-2022年06月30日)		
	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C	
本期已实现收益	-3,216,620.81	-812,512.22	
本期利润	-10,093,064.77	-4,335,501.10	
加权平均基金份额本期利润	-0.0426	-0.0915	
本期加权平均净值利润率	-4.48%	-9.63%	
本期基金份额净值增长率	-3.43%	-3.62%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)		
	期末可供分配利润	-2,874,385.27	-360,773.62
	期末可供分配基金份额利润	-0.0122	-0.0158
	期末基金资产净值	233,502,459.79	22,527,601.46

期末基金份额净值	0.9878	0.9842
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.22%	-1.58%

注：1、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；

2、本期已实现收益是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。

3、本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 2 日，截止报告期末，本基金基金合同生效不满一年。

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

红塔红土盛利混合 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	6.59%	0.62%	5.19%	0.59%	1.40%	0.03%
过去三个月	5.52%	0.83%	3.96%	0.78%	1.56%	0.05%
过去六个月	-3.43%	0.83%	-4.23%	0.80%	0.80%	0.03%
自基金合同生效起至今	-1.22%	0.69%	-1.88%	0.68%	0.66%	0.01%

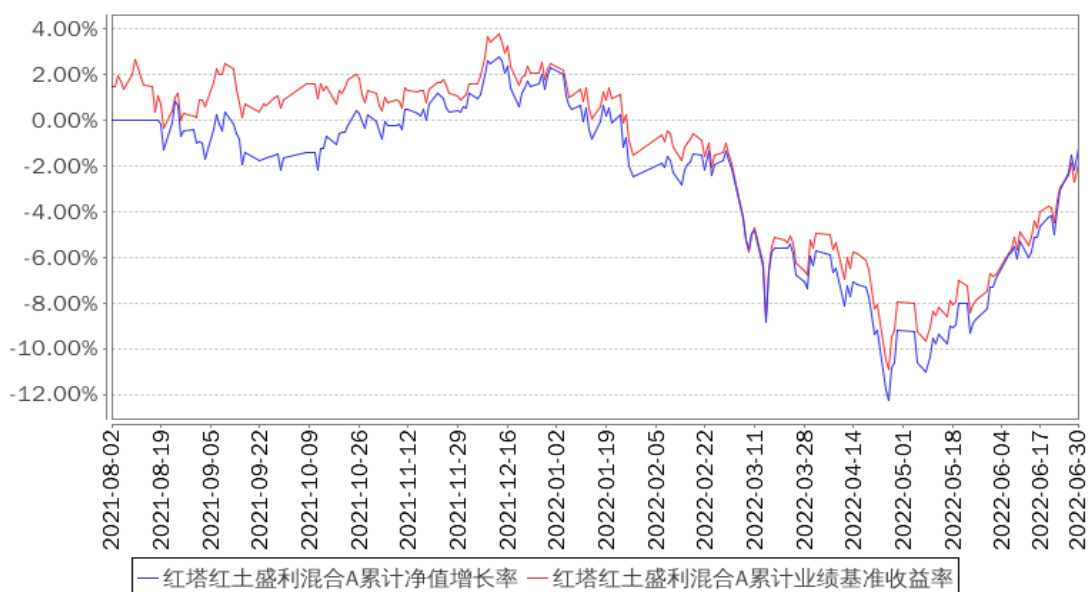
红塔红土盛利混合 C

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	6.56%	0.62%	5.19%	0.59%	1.37%	0.03%

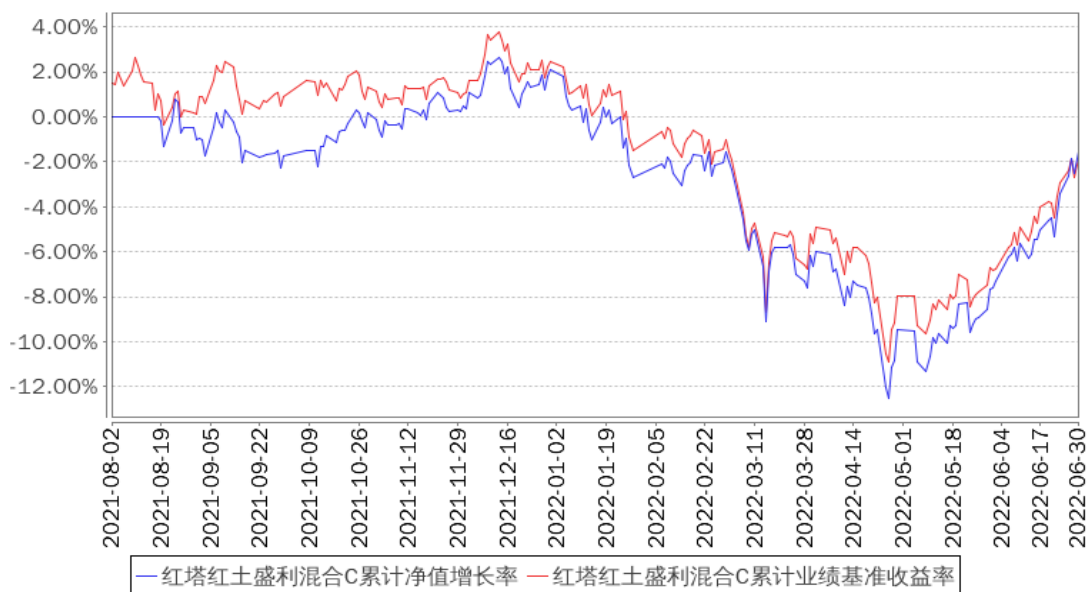
过去三个月	5.42%	0.83%	3.96%	0.78%	1.46%	0.05%
过去六个月	-3.62%	0.83%	-4.23%	0.80%	0.61%	0.03%
自基金合同生效 起至今	-1.58%	0.69%	-1.88%	0.68%	0.30%	0.01%

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

红塔红土盛利混合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



红塔红土盛利混合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：本基金的基金合同于 2021 年 8 月 2 日生效，截至 2022 年 6 月 30 日，基金合同生效未满 1

年。

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

本基金管理人为红塔红土基金管理有限公司（简称“公司”），经中国证券监督管理委员会批准，于 2012 年 6 月 12 日正式成立，注册地位于深圳前海，注册资本 4.96 亿元人民币。其中，红塔证券股份有限公司出资比例为 59.27%，北京市华远集团有限公司出资比例为 30.24%，深圳市创新投资集团有限公司出资比例为 10.49%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

作为一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构，公司将坚持价值投资理念，以专业服务回馈社会，坚持把基金持有人利益放在首位，努力实现基金持有人资产增值。同时，重视投资的风险控制，建立起一套全面完善的风险管理体系，以风险预算为基础，合法合规运作为前提，将风险控制贯穿于整个投资运作的全过程，进而实现专业组合投资。

截止至 2022 年 6 月 30 日，基金公司共有员工 64 人，其中 42 人具有硕士或博士学位；截止 2022 年 6 月 30 日，公司管理 17 只证券投资基金。

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		
吴秋松	基金经理	2021 年 08 月 02 日	-	6 年	复旦大学管理学硕士，哈尔滨工业大学工学学士，CFA。曾先后任职于君证资本管理有限公司、银泰证券有限责任公司，2017 年 10 月加入红塔红土基金管理有限公司，现任职红塔红土基金管理有限公司公募投资一部，为公司投资决策委员会委员。

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从法律法规、行业协会关于从业人员资格管理的相关规定。

2、本基金无基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规，以及《红塔红土盛利混合型证券投资基金基金合同》、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规及基金合同等规定，未从事内幕交易、操纵市场等违法、违规行为，未开展有损于基金份额持有人利益的关联交易，整体运作合法合规。

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》、《红塔红土基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等在研究分析、投资决策、交易执行等各业务环节严格控制，公平对待旗下所有投资组合。

报告期内，基金管理人管理的各投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价格未发现异常差异，各投资组合间不存在违背公平交易原则的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了《红塔红土基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合外，同一投资组合禁止同日反向交易，不同投资组合之间严格限制同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，需经严格审批并留痕备查。

报告期内，本基金与基金管理人管理的其他投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2022 年上半年，国内经济整体先抑后扬，5 月份之前主要受疫情影响，主要经济数据均出现下行，5 月份随着本土疫情的有效控制，全国经济也开始进入了复苏进程，6 月份制造业 PMI 也回到了 50.2%，重回扩张区间。货币流动性方面，央行在今年 1 月 17 日对 7 天逆回购利率和中期借贷便利（MLF）分别降息 10BP，4 月 15 日全面降准 25BP，5 月 20 日实施了非对称降息，1 年期 LPR

不动，5 年期 LPR 下降 15BP，整体来看上半年市场资金流动性较为宽松。

A 股市场 2022 年上半年波动加大，整体是先跌后涨，行业分化明显。2022 年年初至 2 月下旬时，美债收益率加速上行，国内基金发行规模低于预期，A 股热门赛道全面杀跌。3 月至 4 月期间，地缘政治冲突持续时间超市场预期，带来了能源价格的持续上涨，滞涨、中美脱钩等担忧对市场风险偏好构成冲击，同时因疫情影响，A 股市场呈现整体下行的情形。直到 4 月底，随着疫情的有效控制，在市场流动性宽松、保经济政策密集出台、经济基本面环比持续改善等因素催化下，市场迎来了持续两个月的反弹行情。整个上半年来看，只有煤炭行业取得正收益率，电子、计算机和传媒等行业则跌幅靠前。在 4 月底开启的反弹行情中，受益于促进汽车消费政策的支持，以及国内电动汽车渗透率的持续提升，汽车以及新能源汽车行业板块涨幅领先。

本基金报告期内行业配置较为均衡，优选行业内优质龙头公司以及具备中长期成长空间的公司。对于债券市场，我们仍偏谨慎，以高评级短久期的债券为基础构建债券组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红塔红土盛利混合 A 基金份额净值为 0.9878 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.43%；截至本报告期末红塔红土盛利混合 C 基金份额净值为 0.9842 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.62%；同期业绩比较基准收益率为-4.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内宏观经济方面，基建投资有望是 2022 年全年经济实现稳增长的重要抓手，2022 年新增地方政府专项债 3.45 万亿元要求在 6 月底前基本发行完毕，力争在 8 月底前基本使用完毕，下半年仍有可能增加全年专项债规模，也有可能提前下达明年新增专项债，此外还有开发性金融债等准财政手段；房地产投资方面，政府因城施策，除了一线城市外各地区都陆续放松了调控政策，房地产目前仍是国内经济的主要支柱之一，也是国内信用传导的重要产业环节，预计下半年政策仍有进一步放松的可能性；制造业投资 1-5 月累计同比增长 10.6%，虽较 2021 年全年 13.5%有所下降，但也跟 2022 年上半年地缘政治冲突、上游价格上涨、国内疫情等因素有关，随着“宽信用”货币政策的持续发力，国内疫情得到有效控制，上游原材料价格有望回落，下半年制造业投资有望维持较高的增速，尤其是受国家政策鼓励的高技术产业投资。出口方面，随着海外流动性收紧与外需走弱，下半年仍有增速下移的压力；消费方面，国内对疫情的防控已做出经济发展为先的调整，消费有望恢复增长，但整体预计会是弱复苏，主要还是要关注受益于政策刺激的行业，如汽车与家电行业。

随着稳增长政策的落地，社融增速 2022 年下半年有望进入回升阶段，国内经济下半年预计仍处于复苏阶段；同时，虽然通胀有所抬升，但预计在下半年仍不会是我国货币政策的主要压力，

市场流动性预计仍维持宽裕的状态，所以预计 A 股市场下半年仍有不错的投资机会。另一方面，我们认为，市场在 2022 年下半年全面估值提升的难度不小，我们更多的是会关注结构性的机会，尤其是新基建与新能源等相关行业的机会。我们认为新基建和新能源是未来我国实现产业升级的重要发展方向，这其中将会有足够大的市场规模与足够快的发展速度，也即意味着有更多具备投资价值的上市公司，值得我们去挖掘与投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

根据中国证监会的相关规定，本公司针对停牌股票、债券不活跃市场报价等投资品种启用特殊估值流程，由基金估值小组确定相应证券的估值方法。

估值小组成员包括公司领导、运营部门、法律、监察稽核部、研究部等相关人员。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与公司启用特殊估值的流程，发表相关意见和建议，与运营部门、公司领导、研究部相关人员共同商定估值原则和政策。

(3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人分别与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其分别提供银行间同业市场、交易所市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§ 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在红塔红土盛利混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：红塔红土盛利混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,454,044.42	6,763,584.84
结算备付金		68,811.91	255,486.34

存出保证金		53,467.77	93,332.69
交易性金融资产	6.4.7.2	291,734,072.90	378,891,871.41
其中：股票投资		137,014,291.01	171,509,061.41
基金投资		-	-
债券投资		154,719,781.89	207,382,810.00
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	6,000,000.00	17,200,133.80
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,600.00	3,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,917,292.17
资产总计		310,311,997.00	406,124,701.25
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		47,208,162.10	75,399,686.90
应付清算款		6,712,040.83	1,003,214.41
应付赎回款		-	50.87
应付管理人报酬		119,906.74	161,377.28
应付托管费		29,976.70	40,344.32
应付销售服务费		10,455.38	23,585.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,230.98	9,101.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	195,163.02	241,601.92
负债合计		54,281,935.75	76,878,962.68
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	259,265,220.14	322,010,189.83
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-3,235,158.89	7,235,548.74

净资产合计		256,030,061.25	329,245,738.57
负债和净资产总计		310,311,997.00	406,124,701.25

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，红塔红土盛利混合型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 0.9878 元，A 类基金份额 236,376,845.06 份；C 类基金份额净值人民币 0.9842 元，C 类基金份额 22,888,375.08 份；红塔红土盛利混合型证券投资基金基金份额总额合计为 259,265,220.14 份。

6.2 利润表

会计主体：红塔红土盛利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-12,372,257.24
1. 利息收入		61,453.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	37,234.14
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		24,218.99
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,034,324.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,640,907.15
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	2,213,323.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	1,393,259.61
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	-10,399,432.84
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	46.56
减：二、营业总支出		2,056,308.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	808,191.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	202,047.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	91,157.37

4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		836,417.44
其中：卖出回购金融资产支出		836,417.44
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		6,191.36
8. 其他费用	6.4.7.23	112,302.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,428,565.87
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,428,565.87
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-14,428,565.87

注：本基金的基金合同于 2021 年 8 月 2 日生效，因此，无上年度可比期间财务报表数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：红塔红土盛利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	322,010,189.83	-	7,235,548.74	329,245,738.57
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）	322,010,189.83	-	7,235,548.74	329,245,738.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-62,744,969.69	-	-10,470,707.63	-73,215,677.32
（一）、综合收益总额	-	-	-14,428,565.87	-14,428,565.87

(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)	-62,744,969.69	-	3,957,858.24	-58,787,111.45
其中：1. 基金申购款	43,428,324.50	-	-1,548,956.52	41,879,367.98
2. 基金赎回款	-106,173,294.19	-	5,506,814.76	-100,666,479.43
(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)	259,265,220.14	-	-3,235,158.89	256,030,061.25

注：本基金的基金合同于 2021 年 8 月 2 日生效，因此，无上年度可比期间财务报表数据。

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：

杨洁

基金管理人负责人

杨洁

主管会计工作负责人

李志朋

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

红塔红土盛利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2021 年 4 月 15 日下发的证监许可[2021]1303 号文《关于准予红塔红土盛利混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人红塔红土基金管理有限公司（以下简称“红塔红土基金公司”）自 2021 年 4 月 30 日至 2021 年 7 月 28 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2021）验字第 61014670_H05 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。本基金合同于 2021 年 8 月 2 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金（本金）为人民币 220,284,451.00 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 886.40 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 220,285,337.44 元，折合 220,285,337.44 份基金份额。本基金的基金管理人为红塔红土基金公司，注册登记机构为红塔红土基金公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“邮政储蓄银行”）。

在投资者认/申购时收取认/申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 A 类基金份额；在投资者认/申购时不收取认/申购费，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 50%–95%；每隔交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构执行。如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资组合比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+中债总指数（财富）收益率×45%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间经营成果和净值变动情况。

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业务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。

(a) 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。

(b) 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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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、买入返售金融资产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卖出回购金融资产款和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

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

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或资产支持证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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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,财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号),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:

(1) 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。

(a)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、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款,金额分别为 6,763,584.84 元、255,486.34 元、93,332.69 元、17,200,133.80 元、2,917,292.17 元和 3,000.00 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、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为 6,766,389.82 元、255,612.84 元、93,378.89 元、17,202,139.95 元、0.00 元和 3,000.00 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 378,891,871.41 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 381,804,179.75 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息,金额分别为 75,399,686.90 元、1,003,214.41 元、50.87 元、161,377.28 元、40,344.32 元、23,585.11 元、144,323.84 元和 47,278.08 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息,金额分别为 75,446,964.98 元、1,003,214.41 元、50.87 元、161,377.28 元、40,344.32 元、23,585.11 元、144,323.84 元和 0.00 元。

(i)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”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。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”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示,无期初留存收益影响。

(2) 《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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券(股票)交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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(以下简称“资管产品运营业务”)，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日

前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	12,454,044.42
等于：本金	12,451,530.27
加：应计利息	2,514.15
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	12,454,044.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	143,219,118.43	-	137,014,291.01	-6,204,827.42	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,019,500.00	245,041.10	13,247,641.10	-16,900.00
	银行间市场	139,282,796.57	1,820,140.79	141,472,140.79	369,203.43
	合计	152,302,296.57	2,065,181.89	154,719,781.89	352,303.43
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	295,521,415.00	2,065,181.89	291,734,072.90	-5,852,523.99	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	101,860.46
其中：交易所市场	94,647.76
银行间市场	7,212.70
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	24,795.19
预提银行间账户维护费	9,000.00
合计	195,163.02

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

红塔红土盛利混合 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	243,625,252.80	243,625,252.80
本期申购	15,747,700.64	15,747,700.64
本期赎回（以“-”号填列）	-22,996,108.38	-22,996,108.38
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	236,376,845.06	236,376,845.06

红塔红土盛利混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	78,384,937.03	78,384,937.03
本期申购	27,680,623.86	27,680,623.86
本期赎回（以“-”号填列）	-83,177,185.81	-83,177,185.81
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	22,888,375.08	22,888,375.08

注：申购含红利再投、转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

红塔红土盛利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,780,750.69	3,793,653.44	5,574,404.13
本期利润	-3,216,620.81	-6,876,443.96	-10,093,064.77
本期基金份额交易产生的变动数	-111,580.95	1,755,856.32	1,644,275.37
其中：基金申购款	-142,877.44	-335,125.36	-478,002.80
基金赎回款	31,296.49	2,090,981.68	2,122,278.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,547,451.07	-1,326,934.20	-2,874,385.27

红塔红土盛利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	442,404.64	1,218,739.97	1,661,144.61
本期利润	-812,512.22	-3,522,988.88	-4,335,501.10
本期基金份额交易产生的变动数	139,638.57	2,173,944.30	2,313,582.87
其中：基金申购款	171,253.52	-1,242,207.24	-1,070,953.72
基金赎回款	-31,614.95	3,416,151.54	3,384,536.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-230,469.01	-130,304.61	-360,773.62

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	34,191.16
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	2,467.63
其他	575.35
合计	37,234.14

注：“其他”为保证金存款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	121,863,996.10
减：卖出股票成本总额	127,157,263.68
减：交易费用	347,639.57

买卖股票差价收入	-5,640,907.15
----------	---------------

6.4.7.14.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,379,777.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-166,454.47
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	2,213,323.45

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	193,355,015.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	189,874,094.24
减：应计利息总额	3,644,182.74
减：交易费用	3,193.30
买卖债券差价收入	-166,454.47

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,393,259.61
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	1,393,259.61

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-10,399,432.84
股票投资	-10,654,243.93
债券投资	254,811.09
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	-10,399,432.84

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	46.56
合计	46.56

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	27,000.00
其他	600.00
开户费	400.00
合计	112,302.56

注：“其他”为上交所账户查询费。

6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
红塔红土基金公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
邮储银行	基金托管人
红塔证券股份有限公司（“红塔证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
红塔证券	107,714,743.02	50.93

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
红塔证券	100,315.40	56.93	53,000.67	56.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 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	808,191.91
其中：支付销售机构的客户维护费	235,215.41

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	202,047.99

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C	合计
红塔红土基金公司	—	9,401.10	9,401.10
红塔证券	—	16,537.32	16,537.32
合计	—	25,938.42	25,938.42

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
邮政储蓄银行	12,454,044.42	34,191.16

注：本基金的活期银行存款由基金托管人邮政储蓄银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2022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)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							股)			
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新股锁定	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688297	中无人机	2022年6月17日	6个月	新股锁定	32.35	45.88	6,704	216,874.40	307,579.52	-
688125	安达智能	2022年4月8日	6个月	新股锁定	60.55	43.43	3,207	194,183.85	139,280.01	-
688322	奥比中光	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	5,248	162,635.52	162,635.52	-
688270	臻镭科技	2022年1月20日	6个月	新股锁定	61.88	59.87	2,575	159,341.00	154,165.25	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	3,407	131,033.22	131,033.22	-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	32,961	125,911.02	125,911.02	-
688150	莱特光电	2022年3月10日	6个月	新股锁定	22.05	19.60	5,586	123,171.30	109,485.60	-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688163	赛伦生物	2022年3月2日	6个月	新股锁定	33.03	23.56	3,607	119,139.21	84,980.92	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	5,425	118,970.25	118,970.25	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	3,232	108,756.80	108,756.80	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
688283	坤恒顺维	2022年2月8日	6个月	新股锁定	33.80	45.41	1,595	53,911.00	72,428.95	-
301200	大族	2022	6个月	新股锁	76.56	51.92	257	19,675.92	13,343.44	-

	数控	年 2 月 18 日		定							
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁 定	38.39	23.90	496	19,041.44	11,854.40		-
301217	铜冠 铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定	17.27	14.83	1,086	18,755.22	16,105.38		-
301238	瑞泰 新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股锁 定	19.18	32.07	975	18,700.50	31,268.25		-
301248	杰创 智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定	39.07	29.87	454	17,737.78	13,560.98		-
301201	诚达 药业	2022 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定	72.69	71.54	242	17,590.98	17,312.68		-
301215	中汽 股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股锁 定	3.80	6.39	4,585	17,423.00	29,298.15		-
301235	华康 医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁 定	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74		-
301150	中一 科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁 定	163.56	82.76	147	16,028.88	12,165.72		-
301151	冠龙 节能	2022 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定	30.82	21.46	506	15,594.92	10,858.76		-
301162	国能 日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股锁 定	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74		-
301302	华如 科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定	52.03	56.42	281	14,620.43	15,854.02		-
301139	元道 通信	2022 年 6 月 30 日	1-6 个 月 (含)	新股锁 定	38.46	38.46	379	14,576.34	14,576.34		-
301216	万凯 新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁 定	35.68	29.84	406	14,486.08	12,115.04		-
300834	星辉 环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股锁 定	55.57	30.03	259	14,392.63	7,777.77		-

301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股锁定	50.31	70.37	285	14,338.35	20,055.45	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	251	14,276.88	14,161.42	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股锁定	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301175	中科环保	2022年6月30日	1-6个月(含)	新股锁定	3.82	3.82	3,663	13,992.66	13,992.66	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	1,721	13,854.05	17,347.68	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	244	13,832.36	10,213.84	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	344	13,718.72	10,694.96	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	674	13,432.82	21,150.12	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股锁定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股锁定	42.50	32.02	397	12,962.50	12,711.94	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股锁定	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定	33.65	33.65	360	12,114.00	12,114.00	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	243	11,736.90	10,128.24	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	183	11,547.30	7,292.55	-
301222	浙江恒威	2022年3月	6个月	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-

		2 日									
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-	
301135	瑞德智能	2022 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-	
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	173.98	87.82	108	10,438.80	9,484.56	-	
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-	
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-	
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股锁定	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-	
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-	
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	64.08	37.52	133	8,522.64	4,990.16	-	
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-	
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-	
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-	
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-	
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 47,208,162.10 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012280586	22 中石化 SCP006	2022 年 07 月 05 日	100.72	100,000	10,072,301.37
042100372	21 电网 CP008	2022 年 07 月 05 日	102.27	100,000	10,226,808.22
012105059	21 深能源 SCP001	2022 年 07 月 06 日	101.65	100,000	10,164,667.40
012180046	21 广州地铁 SCP011	2022 年 07 月 06 日	101.62	100,000	10,162,194.52
112111153	21 平安银行 CD153	2022 年 07 月 06 日	99.94	100,000	9,994,161.59
合计				500,000	50,620,133.10

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、管理层和各专业委员会、监察稽核部等职能部门、各业务及业务管理部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金运作过程进行合规检查和风险控制评估等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范策略和控制措施等；监察稽核部负责指导各业务及业务管理部门开展风险管理工作，协调其他各部门开展运作风险管理，并进行投资风险分析与绩效评估。

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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	20,126,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	104,450,903.02	90,164,000.00
合计	104,450,903.02	110,290,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、短期融资债券及超短期融资债券。

3、债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,845,386.27	48,691,000.00
合计	29,845,386.27	48,691,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为债券期限小于一年的同业存单。

3、债券投资以全价列示。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
AAA	20,423,492.60	30,300,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	18,101,810.00
合计	20,423,492.60	48,401,810.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为债券期限大于一年的国债、中票和政策性金融债。

3、债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。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资产的公允价

值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外,本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息,可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息,因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产及债券投资等,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。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2022年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	12,454,044.42	-	-	-	-	-	12,454,044.42
结算备付金	68,811.91	-	-	-	-	-	68,811.91
存出保证金	53,467.77	-	-	-	-	-	53,467.77
交易性金融资产	33,430,931.46	81,164,457.14	40,124,393.29	-	-	137,014,291.01	291,734,072.90
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	-	-	6,000,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	1,600.00	1,600.00
资产总计	52,007,255.56	81,164,457.14	40,124,393.29	-	-	137,015,891.01	310,311,997.00
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	119,906.74	119,906.74
应付托管费	-	-	-	-	-	29,976.70	29,976.70
应付清算款	-	-	-	-	-	6,712,040.83	6,712,040.83

卖出回购金融资产款	47,208,162.10	-	-	-	-	-	47,208,162.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,455.38	10,455.38
应交税费	-	-	-	-	-	6,230.98	6,230.98
其他负债	-	-	-	-	-	195,163.02	195,163.02
负债总计	47,208,162.10	-	-	-	-	7,073,773.65	54,281,935.75
利率敏感度缺口	4,799,093.46	81,164,457.14	40,124,393.29	-	-	129,942,117.36	256,030,061.25
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,763,584.84	-	-	-	-	-	6,763,584.84
结算备付金	255,486.34	-	-	-	-	-	255,486.34
存出保证金	93,332.69	-	-	-	-	-	93,332.69
交易性金融资产	19,823,000.00	88,037,810.00	99,522,000.00	-	-	171,509,061.41	378,891,871.41
买入返售金融资产	17,200,133.80	-	-	-	-	-	17,200,133.80
应收申购款	-	-	-	-	-	3,000.00	3,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	2,917,292.17	2,917,292.17
资产总计	44,135,537.67	88,037,810.00	99,522,000.00	-	-	174,429,353.58	406,124,701.25
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	50.87	50.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	161,377.28	161,377.28
应付托管费	-	-	-	-	-	40,344.32	40,344.32
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,003,214.41	1,003,214.41
卖出回购金融资产款	75,399,686.90	-	-	-	-	-	75,399,686.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23,585.11	23,585.11
应交税费	-	-	-	-	-	9,101.87	9,101.87
其他负债	-	-	-	-	-	241,601.92	241,601.92
负债总计	75,399,686.90	-	-	-	-	1,479,275.78	76,878,962.68
利率敏感度缺口	-31,264,149.23	88,037,810.00	99,522,000.00	-	-	172,950,077.80	329,245,738.57

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的
----	--

影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值			
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1、市场利率上升25个基准点	-85,136.45	-157,558.72
	2、市场利率下降25个基准点	85,308.52	157,889.44

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。

本基金持有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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	137,014,291.01	53.51	171,509,061.41	52.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	154,719,781.89	60.43	207,382,810.00	62.99
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	291,734,072.90	113.95	378,891,871.41	115.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	12,214,470.21	13,573,039.39
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-12,214,470.21	-13,573,039.39

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	133,420,414.23	170,890,991.00
第二层次	155,592,518.79	208,000,880.41
第三层次	2,721,139.88	-

合计	291,734,072.90	378,891,871.41
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

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	137,014,291.01	44.15
	其中：股票	137,014,291.01	44.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	154,719,781.89	49.86
	其中：债券	154,719,781.89	49.86
	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	6,000,000.00	1.93
	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	12,522,856.33	4.04
8	其他各项资产	55,067.77	0.02
9	合计	310,311,997.00	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	4,826,014.44	1.88
C	制造业	80,183,968.77	31.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,110,856.00	0.82
E	建筑业	1,010,800.00	0.39
F	批发和零售业	924,350.12	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	2,439,058.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,477,525.17	2.92
J	金融业	26,542,312.00	10.37
K	房地产业	3,457,800.00	1.35
L	租赁和商务服务业	1,734,643.96	0.68
M	科学研究和技术服务业	2,935,162.71	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	163,804.10	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	845,425.74	0.33
R	文化、体育和娱乐业	2,362,570.00	0.92
S	综合	-	-
	合计	137,014,291.01	53.51

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	600036	招商银行	98,500	4,156,700.00	1.62
2	600519	贵州茅台	2,000	4,090,000.00	1.60
3	601318	中国平安	79,100	3,693,179.00	1.44
4	000858	五粮液	14,200	2,867,406.00	1.12
5	600919	江苏银行	389,000	2,769,680.00	1.08
6	000063	中兴通讯	106,400	2,716,392.00	1.06
7	300705	九典制药	119,980	2,617,963.60	1.02
8	300083	创世纪	200,331	2,303,806.50	0.90

9	002142	宁波银行	63,300	2,266,773.00	0.89
10	000333	美的集团	36,300	2,192,157.00	0.86
11	002594	比亚迪	6,400	2,134,336.00	0.83
12	600900	长江电力	91,300	2,110,856.00	0.82
13	002384	东山精密	90,000	2,063,700.00	0.81
14	601615	明阳智能	60,000	2,028,000.00	0.79
15	601166	兴业银行	100,000	1,990,000.00	0.78
16	002966	苏州银行	320,000	1,952,000.00	0.76
17	300799	左江科技	25,800	1,940,160.00	0.76
18	600460	士兰微	37,000	1,924,000.00	0.75
19	600004	白云机场	128,400	1,914,444.00	0.75
20	002371	北方华创	6,800	1,884,416.00	0.74
21	000001	平安银行	124,000	1,857,520.00	0.73
22	000002	万科 A	90,000	1,845,000.00	0.72
23	600745	闻泰科技	20,100	1,710,711.00	0.67
24	000977	浪潮信息	63,600	1,684,128.00	0.66
25	002049	紫光国微	8,700	1,650,564.00	0.64
26	300347	泰格医药	14,100	1,613,745.00	0.63
27	600383	金地集团	120,000	1,612,800.00	0.63
28	601857	中国石油	302,000	1,600,600.00	0.63
29	002271	东方雨虹	31,000	1,595,570.00	0.62
30	603444	吉比特	4,100	1,590,800.00	0.62
31	000783	长江证券	266,000	1,577,380.00	0.62
32	002385	大北农	200,000	1,562,000.00	0.61
33	300059	东方财富	61,200	1,554,480.00	0.61
34	601012	隆基绿能	22,800	1,519,164.00	0.59
35	603288	海天味业	16,800	1,518,048.00	0.59
36	600030	中信证券	70,000	1,516,200.00	0.59
37	600887	伊利股份	38,800	1,511,260.00	0.59
38	000568	泸州老窖	6,000	1,479,240.00	0.58
39	300408	三环集团	48,800	1,468,880.00	0.57
40	002008	大族激光	43,800	1,451,094.00	0.57
41	600276	恒瑞医药	38,200	1,416,838.00	0.55
42	688072	拓荆科技	9,000	1,395,900.00	0.55
43	000999	华润三九	30,000	1,350,000.00	0.53
44	600031	三一重工	70,100	1,336,106.00	0.52
45	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.52
46	601888	中国中免	5,500	1,281,115.00	0.50
47	600019	宝钢股份	212,800	1,281,056.00	0.50
48	601225	陕西煤业	60,000	1,270,800.00	0.50
49	603259	药明康德	12,200	1,268,678.00	0.50
50	002179	中航光电	20,020	1,267,666.40	0.50

51	300223	北京君正	11,600	1,232,500.00	0.48
52	002011	盾安环境	100,000	1,229,000.00	0.48
53	002415	海康威视	33,200	1,201,840.00	0.47
54	600926	杭州银行	80,000	1,198,400.00	0.47
55	600196	复星医药	26,800	1,181,612.00	0.46
56	300760	迈瑞医疗	3,700	1,158,840.00	0.45
57	600309	万华化学	11,900	1,154,181.00	0.45
58	002129	TCL 中环	18,800	1,107,132.00	0.43
59	300750	宁德时代	2,000	1,068,000.00	0.42
60	600536	中国软件	26,000	1,055,340.00	0.41
61	002812	恩捷股份	4,200	1,051,890.00	0.41
62	603668	天马科技	50,000	1,024,500.00	0.40
63	688568	中科星图	15,000	1,016,400.00	0.40
64	002939	长城证券	100,000	1,016,000.00	0.40
65	002475	立讯精密	30,000	1,013,700.00	0.40
66	601668	中国建筑	190,000	1,010,800.00	0.39
67	601688	华泰证券	70,000	994,000.00	0.39
68	601949	中国出版	200,000	964,000.00	0.38
69	300122	智飞生物	8,600	954,686.00	0.37
70	300207	欣旺达	30,000	948,000.00	0.37
71	601877	正泰电器	26,300	941,014.00	0.37
72	300073	当升科技	10,000	903,400.00	0.35
73	000963	华东医药	20,000	903,200.00	0.35
74	002739	万达电影	65,800	898,170.00	0.35
75	000725	京东方 A	225,600	888,864.00	0.35
76	002466	天齐锂业	7,000	873,600.00	0.34
77	002821	凯莱英	3,000	867,000.00	0.34
78	688018	乐鑫科技	7,500	843,000.00	0.33
79	300035	中科电气	30,000	838,500.00	0.33
80	002230	科大讯飞	19,400	799,668.00	0.31
81	600585	海螺水泥	21,800	769,104.00	0.30
82	601238	广汽集团	50,000	762,000.00	0.30
83	300316	晶盛机电	11,200	757,008.00	0.30
84	300638	广和通	28,200	747,018.00	0.29
85	300015	爱尔眼科	15,900	711,843.00	0.28
86	000625	长安汽车	40,000	692,800.00	0.27
87	002241	歌尔股份	18,800	631,680.00	0.25
88	601899	紫金矿业	66,700	622,311.00	0.24
89	300124	汇川技术	9,400	619,178.00	0.24
90	002352	顺丰控股	9,400	524,614.00	0.20
91	600176	中国巨石	30,000	522,300.00	0.20
92	600600	青岛啤酒	5,000	519,600.00	0.20

93	603806	福斯特	7,840	513,676.80	0.20
94	300413	芒果超媒	15,000	500,400.00	0.20
95	002027	分众传媒	65,800	442,834.00	0.17
96	688297	中无人机	6,704	307,579.52	0.12
97	600111	北方稀土	8,400	295,344.00	0.12
98	688322	奥比中光	5,248	162,635.52	0.06
99	688270	臻镭科技	2,575	154,165.25	0.06
100	301139	元道通信	3,786	145,609.56	0.06
101	301175	中科环保	36,624	139,903.68	0.05
102	688125	安达智能	3,207	139,280.01	0.05
103	301239	普瑞眼科	3,592	120,870.80	0.05
104	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.05
105	688400	凌云光	5,425	118,970.25	0.05
106	688150	莱特光电	5,586	109,485.60	0.04
107	688163	赛伦生物	3,607	84,980.92	0.03
108	688283	坤恒顺维	1,595	72,428.95	0.03
109	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.03
110	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
111	301238	瑞泰新材	975	31,268.25	0.01
112	301215	中汽股份	4,585	29,298.15	0.01
113	301263	泰恩康	674	21,150.12	0.01
114	301122	采纳股份	285	20,055.45	0.01
115	301162	国能日新	334	18,072.74	0.01
116	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.01
117	301153	中科江南	398	17,504.04	0.01
118	301256	华融化学	1,721	17,347.68	0.01
119	301201	诚达药业	242	17,312.68	0.01
120	301217	铜冠铜箔	1,086	16,105.38	0.01
121	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.01
122	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.01
123	301302	华如科技	281	15,854.02	0.01
124	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.01
125	301207	华兰疫苗	251	14,161.42	0.01
126	301248	杰创智能	454	13,560.98	0.01
127	301200	大族数控	257	13,343.44	0.01
128	301103	何氏眼科	397	12,711.94	0.00
129	301150	中一科技	147	12,165.72	0.00
130	301216	万凯新材	406	12,115.04	0.00
131	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
132	301148	嘉戎技术	496	11,854.40	0.00
133	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
134	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00

135	301151	冠龙节能	506	10,858.76	0.00
136	301102	兆讯传媒	344	10,694.96	0.00
137	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
138	301237	和顺科技	244	10,213.84	0.00
139	301258	富士莱	243	10,128.24	0.00
140	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
141	301219	腾远钴业	108	9,484.56	0.00
142	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
143	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
144	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
145	300834	星辉环材	259	7,777.77	0.00
146	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
147	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
148	301110	青木股份	183	7,292.55	0.00
149	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
150	301196	唯科科技	133	4,990.16	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	300750	宁德时代	3,964,429.50	1.20
2	002966	苏州银行	2,826,000.00	0.86
3	601857	中国石油	2,788,400.00	0.85
4	000651	格力电器	2,606,677.00	0.79
5	601949	中国出版	2,517,643.00	0.76
6	300014	亿纬锂能	2,513,236.00	0.76
7	300705	九典制药	2,305,295.40	0.70
8	601818	光大银行	2,287,000.00	0.69
9	601225	陕西煤业	2,270,642.00	0.69
10	601166	兴业银行	2,154,513.00	0.65
11	300413	芒果超媒	1,680,190.00	0.51
12	000002	万科 A	1,645,190.00	0.50
13	002385	大北农	1,594,000.00	0.48
14	601615	明阳智能	1,584,482.00	0.48
15	603288	海天味业	1,483,694.80	0.45
16	600383	金地集团	1,448,153.00	0.44
17	600919	江苏银行	1,358,000.00	0.41
18	002142	宁波银行	1,317,123.00	0.40
19	600938	中国海油	1,296,054.00	0.39
20	002508	老板电器	1,268,913.00	0.39

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601818	光大银行	5,172,000.00	1.57
2	601800	中国交建	4,000,703.00	1.22
3	600519	贵州茅台	3,260,546.36	0.99
4	300014	亿纬锂能	3,170,863.00	0.96
5	601166	兴业银行	2,693,701.00	0.82
6	002011	盾安环境	2,652,612.00	0.81
7	000066	中国长城	2,476,412.00	0.75
8	000651	格力电器	2,278,472.00	0.69
9	002236	大华股份	2,272,480.83	0.69
10	300750	宁德时代	2,108,600.00	0.64
11	000963	华东医药	1,996,191.00	0.61
12	600383	金地集团	1,977,625.00	0.60
13	601088	中国神华	1,845,952.00	0.56
14	601238	广汽集团	1,835,987.00	0.56
15	300413	芒果超媒	1,659,067.29	0.50
16	601615	明阳智能	1,624,860.00	0.49
17	601995	中金公司	1,610,486.00	0.49
18	300498	温氏股份	1,541,598.00	0.47
19	600884	杉杉股份	1,537,368.00	0.47
20	601179	中国西电	1,529,410.00	0.46

注：卖出金额按卖出成交金额（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	103,316,737.21
卖出股票收入（成交）总额	121,863,996.10

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	13,247,641.10	5.17
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	91,203,261.92	35.62
6	中期票据	20,423,492.60	7.98
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	29,845,386.27	11.66
9	其他	-	-

10	合计	154,719,781.89	60.43
----	----	----------------	-------

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

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	019658	21 国债 10	130,000	13,247,641.10	5.17
2	101901120	19 中电投 MTN015A	100,000	10,307,191.23	4.03
3	042100372	21 电网 CP008	100,000	10,226,808.22	3.99
4	012103840	21 南航股 SCP030	100,000	10,189,128.77	3.98
5	012105059	21 深能源 SCP001	100,000	10,164,667.40	3.97

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

招商银行（代码：600036）发行主体招商银行股份有限公司的如下违法违规事实于 2022 年 3 月 21 日受到中国银行保险监督管理委员会罚款合计 300 万元的处罚：（一）不良贷款余额 EAST 数据存在偏差，（二）漏报贷款核销业务 EAST 数据，（三）漏报信贷资产转让业务 EAST 数据，（四）未报送权益类投资业务 EAST 数据，（五）未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据等，共计 13 条违规行为。

创世纪（代码：300083）发行主体广东创世纪智能装备集团股份有限公司因信息披露虚假或严重误导性陈述，于 2022 年 1 月 5 日受到深圳交易所监管关注处分的处罚决定。

基金的基金经理根据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序进行了投资，符合相关法律法规和公司投资管理制度。

除招商银行、创世纪外，本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期未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

基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	53,467.77
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,600.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,067.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
红塔红土 盛利混合 A	75	3,151,691.27	235,471,389.58	99.62	905,455.48	0.38
红塔红土 盛利混合 C	218	104,992.55	15,472,875.96	67.60	7,415,499.12	32.40
合计	293	884,864.23	250,944,265.54	96.79	8,320,954.60	3.21

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	红塔红土盛利混合 A	231.36	0.0001
	红塔红土盛利混合 C	123.47	0.0005
	合计	354.83	0.0001

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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 放式基金	红塔红土盛利混合 A	0
	红塔红土盛利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	红塔红土盛利混合 A	0
	红塔红土盛利混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C
基金合同生效日 (2021 年 08 月 02 日) 基金份额总额	220,072,193.21	213,144.23
本报告期期初基金份额总额	243,625,252.80	78,384,937.03
本报告期基金总申购份额	15,747,700.64	27,680,623.86
减：本报告期基金总赎回份额	22,996,108.38	83,177,185.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	236,376,845.06	22,888,375.08

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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

2022 年 1 月 12 日，李凌先生离任本基金管理人红塔红土基金管理有限公司（以下简称“公司”）董事长，新任公司首席信息官。

2022 年 1 月 12 日，公司总经理杨洁女士代为履行董事长职务。

2022 年 2 月 21 日，龚香林先生就任公司董事长，总经理杨洁女士不再代为履行董事长职务。

2022 年 5 月 10 日，段皓静女士离任公司督察长，董事长龚香林先生代为履行督察长职务。

本报告期内，基金托管人的专门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

报告期内无涉及本基金管理人、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

本基金本报告期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

本基金管理人于 2022 年 3 月 21 日公告改聘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，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）不再为本基金提供审计服务。该变更事项已由红塔红土基金管理有限公司第四届董事会第二次会议审议通过。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自 2022 年度起为本基金提供审计服务至今。

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

报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关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 (%)	
红塔证券	2	107,714,743.02	50.93	100,315.40	56.93	-
安信证券	1	103,786,587.46	49.07	75,899.54	43.07	-

注：本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。

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 (%)
红塔证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	18,078,658.00	100.00	103,000,000.00	100.00	-	-

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	关于红塔红土基金管理有限公司旗下部分基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 01 月 01 日
2	关于红塔红土基金管理有限公司旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 01 月 01 日
3	红塔红土基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 01 月 01 日
4	红塔红土基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 01 月 14 日
5	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 01 月 24 日
6	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 01 月 24 日
7	红塔红土基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 01 月 27 日
8	红塔红土基金管理有限公司旗下基金产品风险等级划分结果（2021 年下半年）	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 01 月 27 日
9	关于红塔红土基金管理有限公司旗下部分基金参与泰信财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 02 月 21 日
10	红塔红土基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 02 月 22 日
11	红塔红土盛利混合型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 02 月 28 日
12	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金关联交易的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 03 月 08 日
13	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 03 月 21 日
14	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2021 年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 03 月 31 日
15	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2021 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 03 月 31 日
16	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 04 月 22 日
17	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 04 月 22 日
18	红塔红土盛利混合型证券投资基金招募说明书及产品资料概要更新的	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 04 月 22 日

	提示性公告		
19	红塔红土盛利混合型证券投资基金更新招募说明书（2022 年 1 号）	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 04 月 22 日
20	红塔红土盛利混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 04 月 22 日
21	红塔红土盛利混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 04 月 22 日
22	红塔红土基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 05 月 12 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	2022-01-01 至 2022-06-30	109,999,900.00	-	-	109,999,900.00	42.4300
	2	2022-01-01 至 2022-06-30	107,999,900.00	-	-	107,999,900.00	41.6600
产品特有风险							
<p>1、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>2、流动性风险 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> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，可能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，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有</p>							

人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

6、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、红塔红土盛利混合型证券投资基金基金合同；
- 3、红塔红土盛利混合型证券投资基金托管协议；
- 4、红塔红土盛利混合型证券投资基金招募说明书；
- 5、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：广东省深圳市南山区侨香路 4068 号智慧广场 A 栋 801

基金托管人的办公场所：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

12.3 查阅方式

投资者可通过基金管理人网站，或在营业期间到基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

客服热线：4001-666-916（免长途话费）

公司网址：www.htamc.com.cn

红塔红土基金管理有限公司

2022 年 08 月 31 日