

红土创新智能制造混合型发起式证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>12</b>
6.1 审计报告基本信息	12
6.2 审计报告的基本内容	12
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>14</b>
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	15
7.3 净资产变动表	17
7.4 报表附注	18
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况	47

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
8.12 投资组合报告附注.....	57
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
9.3 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.....	58
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	58
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	58
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4 基金投资策略的改变.....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8 其他重大事件.....	60
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
13.1 备查文件目录.....	62
13.2 存放地点.....	63
13.3 查阅方式.....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金
基金简称	红土创新智能制造混合型发起式
基金主代码	013250
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 8 日
基金管理人	红土创新基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	145,185,179.18 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于智能制造相关标的，力求把握中国实施制造强国战略的发展契机，紧追制造升级的高速发展趋势，在严格控制风险的前提下，努力获取超过业绩比较基准的收益，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、固定收益类资产投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中证智能制造主题指数收益率×60%+中证全债指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 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		红土创新基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	殷喆	朱绍纲
	联系电话	0755-33011858	(010) 85238309
	电子邮箱	yinz@htcxfund.com	zhzsg@hxb.com.cn
客户服务电话		0755-33011866	95577
传真		0755-33011855	(010) 85238680
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	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
办公地址		深圳市南山区海德三道1066号深创投广场48层	北京市东城区建国门内大街22号(100005)
邮政编码		518048	100005
法定代表人		阮菲	李民吉

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
----------------	------

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	红土创新基金管理有限公司	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 48 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年 9 月 8 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-32,967,242.13	-20,470,066.35	753,276.55
本期利润	-20,480,500.83	-38,478,669.32	6,945,442.80
加权平均基金份额本期利润	-0.1340	-0.2217	0.0312
本期加权平均净值利润率	-17.28%	-25.25%	3.08%
本期基金份额净值增长率	-17.23%	-23.63%	2.84%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-50,804,228.95	-32,555,016.59	352,361.19
期末可供分配基金份额利润	-0.3499	-0.2146	0.0019
期末基金资产净值	94,380,950.23	119,173,833.80	192,204,943.89
期末基金份额净值	0.6501	0.7854	1.0284
3.1.3 累计期末指	2023 年末	2022 年末	2021 年末

标			
基金份额 累计净值 增长率	-34.99%	-21.46%	2.84%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2. 期末可供分配利润, 采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

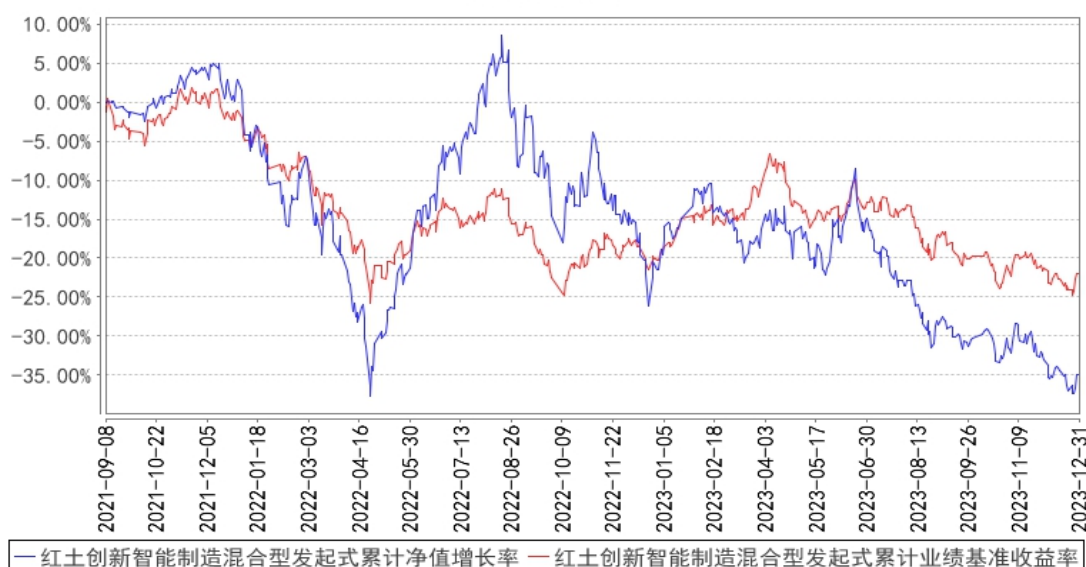
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.70%	1.26%	-2.79%	0.84%	-3.91%	0.42%
过去六个月	-23.61%	1.22%	-10.50%	0.86%	-13.11%	0.36%
过去一年	-17.23%	1.43%	-2.29%	0.89%	-14.94%	0.54%
自基金合同生效起至今	-34.99%	1.69%	-22.01%	0.99%	-12.98%	0.70%

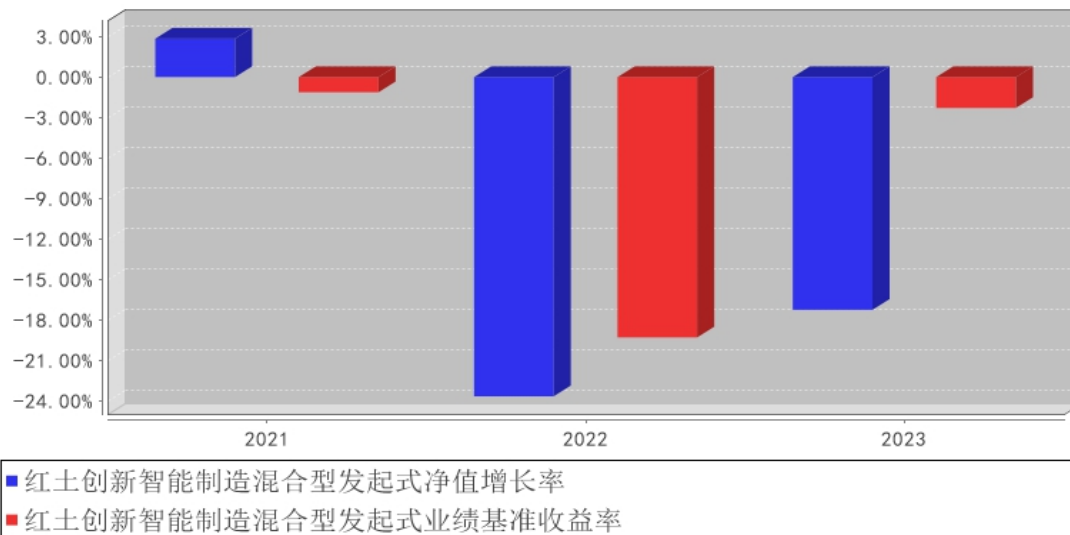
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

红土创新智能制造混合型发起式累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

红土创新智能制造混合型发起式基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上，借力股东对创业投资行业的深入理解，外加国内独创的博士后工作站研究支持，充分利用一级市场优势向二级市场延伸，将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至2023年12月31日，红土创新基金共管理21只公募基金，资产管理规模200.46亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
盖俊	本基金的	2023年8	-	17年	历任长城基金管理有限公司行业研究员；



龙	基金经理	月 14 日			宝盈基金管理有限公司研究员、专户投资经理、基金经理。现任本公司投资部总监，红土创新转型精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、红土创新科技创新股票型证券投资基金（LOF）、红土创新新科技股票型发起式证券投资基金、红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金、红土创新医疗保健股票型发起式证券投资基金、红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。
王尚博	本基金的基金经理	2021 年 9 月 8 日	2023 年 8 月 14 日	11 年	香港中文大学全球政治经济专业硕士，历任诺安基金股票交易员、QDII 交易员，宝盈基金宏观策略、周期、制造行业研究员，基金经理助理，任本公司红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金、红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。

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

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

3. 报告截止日至批准送出日期间，自 2024 年 2 月 7 日起赵波新任本基金基金经理，与盖俊龙共同担任本基金基金经理。

#### 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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司旗下投资组合在报告期内交易过程中未发现存在不公平交易及异常交易的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2023 年，经济恢复呈现高开低走，上半年普遍预期的疫情放开后经济随欧美 2022 年放开时的强劲增长并没有持续，而是很快走弱，这其中包括美国的加息影响，出口的比较优势减弱，国内房价依然下滑未有企稳以及低迷的出生率等负面因素环绕影响。股票市场也相比全球其他市场走出了最差表现。除了煤炭为代表的高股息以及 AI 代表传媒和通信板块录得了正收益，其他板块都有较深的跌幅。

#### 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 0.6501 元；本报告期基金份额净值增长率为-17.23%，业绩比较基准收益率为-2.29%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，虽然我们仍然没有看到经济恢复的斜率增大，但是各种负面因素已经充分的反应在股市的估值中。从积极的一面去看，去年各种负面因素在今年都有边际转好的迹象，比如美

国的加息周期在去年四季度见顶，今年二季度将进入降息通道，出口在美国的限制和制裁下企稳转暖，房地产的下滑趋势得到抑制，中央出手为各地方政府化债消化房地产影响，加之出生率在疫情第二年也会出现反弹。综合以上因素，判断中国经济的复苏，将呈现前低后高。股票市场相对 2023 年也会迎来反弹。本基金在中国智能制造领域挖掘优质细分赛道和龙头公司进行配置，未来的行业细分赛道中，重点看好新能源车中的智能驾驶，机器人以及无人飞行器等板块机会。智能驾驶在今年是 L3 的元年，无图智能驾驶将在更多的车型应用。机器人也将从定样到小规模生产的阶段，而且更多龙头科技公司将推出自己的机器人样品，各种利好因素将贯穿 2024 年全年，催生行业景气度提升，行业蛋糕做大以及优质公司的涌现，本基金会重点在该领域去发掘投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照本基金合同约定，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 26117 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金(以下简称“红土创新智能制造混合型发起式基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准</p>

	<p>则在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了红土创新智能制造混合型发起式基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于红土创新智能制造混合型发起式基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>红土创新智能制造混合型发起式基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估红土创新智能制造混合型发起式基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算红土创新智能制造混合型发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督红土创新智能制造混合型发起式基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,</p>

	<p>但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对红土创新智能制造混合型发起式基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致红土创新智能制造混合型发起式基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张 振 波   陶 文 欣
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	7,425,096.10	13,238,930.56
结算备付金		450,129.39	385,149.64
存出保证金		145,155.02	237,361.46
交易性金融资产	7.4.7.2	87,284,951.15	107,743,111.12
其中：股票投资		87,284,951.15	107,743,111.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		536,636.64	-
应收股利		-	-
应收申购款		116,316.36	8,294.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		95,958,284.66	121,612,847.05
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		924,457.24	1,757,924.06
应付赎回款		67,949.25	17,556.98
应付管理人报酬		120,253.76	157,477.84
应付托管费		16,033.83	20,997.06
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	448,640.35	485,057.31
负债合计		1,577,334.43	2,439,013.25
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	145,185,179.18	151,728,850.39
未分配利润	7.4.7.12	-50,804,228.95	-32,555,016.59
净资产合计		94,380,950.23	119,173,833.80
负债和净资产总计		95,958,284.66	121,612,847.05

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6501 元，基金份额总额 145,185,179.18 份。

## 7.2 利润表

会计主体：红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-18,280,695.59	-35,709,794.00
1. 利息收入		56,291.82	69,983.30
其中：存款利息收入	7.4.7.13	56,291.82	69,983.30
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-30,860,342.06	-17,834,612.22
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-31,475,082.54	-18,389,481.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-124,395.64	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	739,136.12	554,869.15
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	12,486,741.30	-18,008,602.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	36,613.35	63,437.89
<b>减：二、营业总支出</b>		2,199,805.24	2,768,875.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,781,923.97	2,284,180.81
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	237,589.88	304,557.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		33.31	-
8. 其他费用	7.4.7.23	180,258.08	180,136.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-20,480,500.83	-38,478,669.32



减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,480,500.83	-38,478,669.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-20,480,500.83	-38,478,669.32

### 7.3 净资产变动表

会计主体：红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	151,728,850.39	-	-32,555,016.59	119,173,833.80
二、本期期初净资产	151,728,850.39	-	-32,555,016.59	119,173,833.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,543,671.21	-	-18,249,212.36	-24,792,883.57
（一）、综合收益总额	-	-	-20,480,500.83	-20,480,500.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-6,543,671.21	-	2,231,288.47	-4,312,382.74
其中：1. 基金申购款	25,292,020.60	-	-4,349,447.56	20,942,573.04
2. 基金赎回款	-31,835,691.81	-	6,580,736.03	-25,254,955.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	145,185,179.18	-	-50,804,228.95	94,380,950.23
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	186,898,042.25	-	5,306,901.64	192,204,943.89
二、本期期初净资产	186,898,042.25	-	5,306,901.64	192,204,943.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-35,169,191.86	-	-37,861,918.23	-73,031,110.09
(一)、综合收益总额	-	-	-38,478,669.32	-38,478,669.32
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-35,169,191.86	-	616,751.09	-34,552,440.77
其中：1. 基金申购款	29,029,759.96	-	-1,569,265.79	27,460,494.17
2. 基金赎回款	-64,198,951.82	-	2,186,016.88	-62,012,934.94
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	151,728,850.39	-	-32,555,016.59	119,173,833.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

冀洪涛

周厚桥

焦小川

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金(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[2021]2250号《关于准予红土创新智能制造混合型发起式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《红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币

231,647,026.01 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(2021)第 0871 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 231,705,288.48 份基金份额,其中认购资金利息折合 58,262.47 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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,003,150.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围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上市的股票)、港股通标的的股票、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券(包括可分离交易可转债)、可交换债券等)、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:本基金股票资产及存托凭证的投资比例占基金资产的 60%~95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%),投资于中国智能制造主题股票及存托凭证的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券的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。基金的业绩比较基准为:中证智能制造主题指数收益率×60%+中证全债指数收益率×30%+中证港股通综合指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司于 2024 年 03 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的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。

##### 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。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部



分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

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

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	7,425,096.10	13,238,930.56
等于：本金	7,424,323.04	13,237,417.87
加：应计利息	773.06	1,512.69
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	7,425,096.10	13,238,930.56

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	86,614,646.57	-	87,284,951.15	670,304.58
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	86,614,646.57	-	87,284,951.15	670,304.58
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	119,559,547.84	-	107,743,111.12	-11,816,436.72
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	119,559,547.84	-	107,743,111.12	-11,816,436.72

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	10.41	19.27
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	268,629.94	305,038.04
其中：交易所市场	268,629.94	305,038.04

银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	448,640.35	485,057.31

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	151,728,850.39	151,728,850.39
本期申购	25,292,020.60	25,292,020.60
本期赎回（以“-”号填列）	-31,835,691.81	-31,835,691.81
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	145,185,179.18	145,185,179.18

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 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	-18,576,193.36	-13,978,823.23	-32,555,016.59
本期期初	-18,576,193.36	-13,978,823.23	-32,555,016.59
本期利润	-32,967,242.13	12,486,741.30	-20,480,500.83
本期基金份额交易产生的变动数	2,442,290.38	-211,001.91	2,231,288.47
其中：基金申购款	-3,978,223.89	-371,223.67	-4,349,447.56
基金赎回款	6,420,514.27	160,221.76	6,580,736.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-49,101,145.11	-1,703,083.84	-50,804,228.95

#### 7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	40,416.53	43,082.66
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	12,857.06	22,550.54
其他	3,018.23	4,350.10
合计	56,291.82	69,983.30

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-31,475,082.54	-18,389,481.37
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-31,475,082.54	-18,389,481.37

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	751,002,940.56	1,286,058,189.00
减：卖出股票成本总额	780,599,661.37	1,301,081,140.87
减：交易费用	1,878,361.73	3,366,529.50
买卖股票差价收入	-31,475,082.54	-18,389,481.37

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利息收入	9,246.37	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-133,642.01	-
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	-124,395.64	-

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,327,829.94	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,439,119.93	-
减：应计利息总额	20,959.95	-
减：交易费用	1,392.07	-
买卖债券差价收入	-133,642.01	-

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。



**7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

无。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	739,136.12	554,869.15
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	739,136.12	554,869.15
----	------------	------------

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	12,486,741.30	-18,008,602.97
股票投资	12,486,741.30	-18,008,602.97
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	12,486,741.30	-18,008,602.97

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	18,599.58	60,728.26
基金转换费收入	18,013.77	2,709.63
合计	36,613.35	63,437.89

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
交易费用	-	136.97
组合费	258.08	-
合计	180,258.08	180,136.97

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《红土创新基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2024年1月1日起，本基金的管理费年费率由1.5%调低至1.2%。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
红土创新基金管理有限公司（“红土创新”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）	基金托管人、基金销售机构
深创投红土资产管理（深圳）有限公司（“深创投红土资管”）	基金管理人的全资子公司
深圳市创新投资集团有限公司（“深创投”）	基金管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,781,923.97	2,284,180.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	480,097.11	631,228.28
应支付基金管理人的净管理费	1,301,826.86	1,652,952.53

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

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

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	237,589.88	304,557.54

注：支付基金托管人华夏银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 7.4.10.4 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

### 7.4.10.4.1 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。

### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金合同生效日（2021年9月8日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	16,344,807.53	8,001,800.00
报告期间申购/买入总份额	6,103,515.63	8,343,007.53
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	22,448,323.16	16,344,807.53
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.46%	10.7700%

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 基金管理人红土创新投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行	7,425,096.10	40,416.53	13,238,930.56	43,082.66

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

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

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

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险、汇率风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短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。

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

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

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



### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,425,096.10	-	-	-	7,425,096.10
结算备付金	450,129.39	-	-	-	450,129.39
存出保证金	145,155.02	-	-	-	145,155.02
交易性金融资产	-	-	-	87,284,951.15	87,284,951.15
应收申购款	-	-	-	116,316.36	116,316.36
应收清算款	-	-	-	536,636.64	536,636.64
资产总计	8,020,380.51	-	-	87,937,904.15	95,958,284.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	67,949.25	67,949.25
应付管理人报酬	-	-	-	120,253.76	120,253.76
应付托管费	-	-	-	16,033.83	16,033.83
应付清算款	-	-	-	924,457.24	924,457.24
其他负债	-	-	-	448,640.35	448,640.35
负债总计	-	-	-	1,577,334.43	1,577,334.43
利率敏感度缺口	8,020,380.51	-	-	86,360,569.72	94,380,950.23
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	13,238,930.56	-	-	-	13,238,930.56
结算备付金	385,149.64	-	-	-	385,149.64
存出保证金	237,361.46	-	-	-	237,361.46
交易性金融资产	-	-	-	107,743,111.12	107,743,111.12
应收申购款	-	-	-	8,294.27	8,294.27
资产总计	13,861,441.66	-	-	107,751,405.39	121,612,847.05
负债					

应付赎回款	-	-	-	17,556.98	17,556.98
应付管理人报酬	-	-	-	157,477.84	157,477.84
应付托管费	-	-	-	20,997.06	20,997.06
应付清算款	-	-	-	1,757,924.06	1,757,924.06
其他负债	-	-	-	485,057.31	485,057.31
负债总计	-	-	-	2,439,013.25	2,439,013.25
利率敏感度缺口	13,861,441.66	-	-	-105,312,392.14	119,173,833.80

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	10,667,632.16	-	10,667,632.16
资产合计	-	10,667,632.16	-	10,667,632.16
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	10,667,632.16	-	10,667,632.16
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	533,381.61	-
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-533,381.61	-

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	87,284,951.15	92.48	107,743,111.12	90.41
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	87,284,951.15	92.48	107,743,111.12	90.41

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证智能制造主题指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 中证智能制造主题指数上升 5%	7,498,198.81	9,345,644.54
	2. 中证智能制造主题指数下降 5%	-7,498,198.81	-9,345,644.54

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日

第一层次	87,284,951.15	107,595,460.77
第二层次	-	-
第三层次	-	147,650.35
合计	87,284,951.15	107,743,111.12

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

<p>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。</p> <p>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。</p>
--

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	147,650.35	147,650.35
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	167,851.75	167,851.75
当期利得或损失总额	-	20,201.40	20,201.40
其中：计入损益的利得或损失	-	20,201.40	20,201.40
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	5,697,393.50	5,697,393.50
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	388,252.03	388,252.03
转出第三层次	-	4,488,987.43	4,488,987.43
当期利得或损失总额	-	-1,449,007.75	-1,449,007.75
其中：计入损益的利得或损失	-	-1,449,007.75	-1,449,007.75
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	147,650.35	147,650.35
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-24,574.44	-24,574.44

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

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产——股票投资	147,650.35	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-0.7386	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	87,284,951.15	90.96
	其中：股票	87,284,951.15	90.96
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	7,875,225.49	8.21
8	其他各项资产	798,108.02	0.83
9	合计	95,958,284.66	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	71,761,061.98	76.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供	-	-

	应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,856,257.01	5.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	76,617,318.99	81.18

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者必需品	3,247,992.16	3.44
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	7,419,640.00	7.86
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	10,667,632.16	11.30

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601127	赛力斯	71,500	5,448,300.00	5.77
2	688630	芯碁微装	54,592	4,660,519.04	4.94
3	002387	维信诺	361,800	4,055,778.00	4.30
4	002920	德赛西威	25,800	3,341,358.00	3.54
5	603596	伯特利	48,200	3,340,260.00	3.54
6	01316	耐世特	727,000	3,247,992.16	3.44



7	300351	永贵电器	154,600	3,203,312.00	3.39
8	603009	北特科技	214,200	3,176,586.00	3.37
9	300572	安车检测	172,300	3,113,461.00	3.30
10	688031	星环科技	46,745	3,041,697.15	3.22
11	300545	联得装备	88,000	3,040,400.00	3.22
12	02018	瑞声科技	140,500	2,953,914.71	3.13
13	00285	比亚迪电子	87,500	2,902,169.55	3.07
14	002179	中航光电	73,500	2,866,500.00	3.04
15	688017	绿的谐波	16,589	2,546,411.50	2.70
16	600557	康缘药业	119,600	2,454,192.00	2.60
17	600699	均胜电子	136,100	2,444,356.00	2.59
18	603728	鸣志电器	35,100	2,311,335.00	2.45
19	688311	盟升电子	43,390	2,213,323.90	2.35
20	600418	江淮汽车	135,000	2,180,250.00	2.31
21	600114	东睦股份	120,500	1,866,545.00	1.98
22	01810	小米集团-W	110,600	1,563,555.74	1.66
23	600201	生物股份	143,600	1,546,572.00	1.64
24	688301	奕瑞科技	4,636	1,507,905.36	1.60
25	002979	雷赛智能	68,100	1,467,555.00	1.55
26	688270	臻镭科技	21,146	1,445,963.48	1.53
27	688213	思特威	25,371	1,409,612.76	1.49
28	300014	亿纬锂能	33,300	1,405,260.00	1.49
29	688403	汇成股份	130,138	1,372,955.90	1.45
30	688543	国科军工	24,471	1,367,928.90	1.45
31	000625	长安汽车	78,100	1,314,423.00	1.39
32	603297	永新光学	10,900	1,082,915.00	1.15
33	300503	昊志机电	55,800	1,036,206.00	1.10
34	603773	沃格光电	27,600	934,812.00	0.99
35	688099	晶晨股份	14,762	924,544.06	0.98
36	002096	易普力	89,000	922,040.00	0.98
37	002268	电科网安	39,500	887,170.00	0.94
38	300570	太辰光	22,000	859,100.00	0.91
39	300762	上海瀚讯	53,900	812,812.00	0.86
40	002886	沃特股份	22,900	469,221.00	0.50
41	688290	景业智能	5,608	267,894.16	0.28
42	688123	聚辰股份	4,274	261,697.02	0.28
43	688072	拓荆科技	35	8,095.50	0.01
44	688111	金山办公	9	2,845.80	0.00
45	688020	方邦股份	54	2,617.92	0.00
46	688658	悦康药业	68	1,418.48	0.00
47	002487	大金重工	41	1,091.42	0.00
48	688007	光峰科技	3	77.64	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300418	昆仑万维	12,797,970.80	10.74
2	000821	京山轻机	11,114,341.48	9.33
3	600050	中国联通	10,313,000.00	8.65
4	600963	岳阳林纸	9,896,606.80	8.30
5	002558	巨人网络	9,730,946.60	8.17
6	002602	世纪华通	8,990,457.99	7.54
7	001223	欧克科技	8,834,922.00	7.41
8	002555	三七互娱	8,635,592.00	7.25
9	301030	仕净科技	7,974,366.00	6.69
10	688630	芯碁微装	7,922,495.74	6.65
11	300776	帝尔激光	7,889,896.80	6.62
12	300502	新易盛	7,797,738.00	6.54
13	688017	绿的谐波	7,748,487.03	6.50
14	002230	科大讯飞	7,705,776.00	6.47
15	002049	紫光国微	7,703,494.00	6.46
16	688256	寒武纪	7,441,960.31	6.24
17	300115	长盈精密	7,173,455.00	6.02
18	601633	长城汽车	7,167,554.00	6.01
19	300161	华中数控	7,123,378.00	5.98
20	601138	工业富联	7,112,290.00	5.97
21	601127	赛力斯	6,928,537.00	5.81
22	300059	东方财富	6,791,790.00	5.70
23	300494	盛天网络	6,671,057.00	5.60
24	603596	伯特利	6,395,012.00	5.37
25	601390	中国中铁	6,246,818.00	5.24
26	00285	比亚迪电子	6,034,514.66	5.06
27	300033	同花顺	6,006,604.00	5.04
28	00700	腾讯控股	5,938,329.04	4.98
29	600416	湘电股份	5,911,098.00	4.96
30	603728	鸣志电器	5,899,676.00	4.95
31	09868	小鹏汽车-W	5,660,218.24	4.75
32	688053	思科瑞	5,435,945.46	4.56
33	002121	科陆电子	5,308,003.00	4.45
34	300548	博创科技	5,090,095.00	4.27
35	002517	恺英网络	4,901,337.82	4.11
36	600481	双良节能	4,817,489.00	4.04
37	000032	深桑达 A	4,769,962.00	4.00
38	600326	西藏天路	4,748,896.70	3.98

39	002425	凯撒文化	4,724,376.00	3.96
40	300136	信维通信	4,665,303.00	3.91
41	688111	金山办公	4,449,890.08	3.73
42	600760	中航沈飞	4,431,137.00	3.72
43	600114	东睦股份	4,402,657.20	3.69
44	002335	科华数据	4,394,470.00	3.69
45	301308	江波龙	4,357,122.00	3.66
46	002472	双环传动	4,350,029.00	3.65
47	603359	东珠生态	4,333,338.00	3.64
48	000663	永安林业	4,277,973.00	3.59
49	603138	海量数据	4,237,633.38	3.56
50	002292	奥飞娱乐	4,220,558.00	3.54
51	301050	雷电微力	4,155,807.00	3.49
52	600941	中国移动	4,147,271.00	3.48
53	601360	三六零	4,133,463.00	3.47
54	002387	维信诺	4,091,804.00	3.43
55	600418	江淮汽车	4,045,504.46	3.39
56	002918	蒙娜丽莎	4,033,009.00	3.38
57	300559	佳发教育	4,004,538.00	3.36
58	688170	德龙激光	3,985,746.52	3.34
59	300274	阳光电源	3,972,866.00	3.33
60	601728	中国电信	3,930,000.00	3.30
61	600895	张江高科	3,909,711.00	3.28
62	300510	金冠股份	3,887,500.00	3.26
63	600702	舍得酒业	3,882,566.00	3.26
64	000625	长安汽车	3,825,784.00	3.21
65	601799	星宇股份	3,638,042.00	3.05
66	603606	东方电缆	3,634,607.00	3.05
67	002291	遥望科技	3,628,828.00	3.04
68	300394	天孚通信	3,610,382.00	3.03
69	300608	思特奇	3,598,073.00	3.02
70	601595	上海电影	3,594,944.20	3.02
71	01801	信达生物	3,557,987.88	2.99
72	603208	江山欧派	3,553,789.58	2.98
73	688123	聚辰股份	3,542,597.32	2.97
74	300474	景嘉微	3,538,382.00	2.97
75	000799	酒鬼酒	3,522,377.00	2.96
76	601336	新华保险	3,506,717.00	2.94
77	600771	广誉远	3,500,935.00	2.94
78	002605	姚记科技	3,500,000.00	2.94
79	688398	赛特新材	3,499,009.16	2.94
80	300144	宋城演艺	3,486,419.00	2.93
81	600415	小商品城	3,460,083.00	2.90

82	002487	大金重工	3,446,088.52	2.89
83	688378	奥来德	3,443,849.14	2.89
84	01316	耐世特	3,440,913.76	2.89
85	603636	南威软件	3,429,241.00	2.88
86	002869	金溢科技	3,426,283.00	2.88
87	000977	浪潮信息	3,380,000.00	2.84
88	002920	德赛西威	3,361,102.00	2.82
89	688472	阿特斯	3,354,645.12	2.81
90	688031	星环科技	3,334,010.10	2.80
91	300572	安车检测	3,305,425.00	2.77
92	688776	国光电气	3,289,996.48	2.76
93	601666	平煤股份	3,269,286.00	2.74
94	603688	石英股份	3,190,592.00	2.68
95	000837	秦川机床	3,145,396.00	2.64
96	688589	力合微	3,119,092.35	2.62
97	601800	中国交建	3,079,222.00	2.58
98	002149	西部材料	3,046,017.00	2.56
99	300545	联得装备	3,019,743.00	2.53
100	300811	铂科新材	3,017,356.00	2.53
101	688403	汇成股份	2,993,748.91	2.51
102	002414	高德红外	2,989,147.02	2.51
103	300990	同飞股份	2,984,954.00	2.50
104	300351	永贵电器	2,976,979.00	2.50
105	300687	赛意信息	2,962,628.00	2.49
106	01810	小米集团-W	2,940,971.56	2.47
107	600546	山煤国际	2,900,459.00	2.43
108	02018	瑞声科技	2,848,654.94	2.39
109	002873	新天药业	2,840,610.66	2.38
110	603009	北特科技	2,822,110.00	2.37
111	002179	中航光电	2,808,543.58	2.36
112	002572	索菲亚	2,728,579.00	2.29
113	603260	合盛硅业	2,718,899.00	2.28
114	002735	王子新材	2,661,901.00	2.23
115	002992	宝明科技	2,619,865.00	2.20
116	300253	卫宁健康	2,613,194.00	2.19
117	300751	迈为股份	2,602,454.00	2.18
118	02269	药明生物	2,592,092.96	2.18
119	300480	光力科技	2,590,063.00	2.17
120	605128	上海沿浦	2,587,468.00	2.17
121	603915	国茂股份	2,575,947.00	2.16
122	605111	新洁能	2,542,656.68	2.13
123	300364	中文在线	2,540,900.52	2.13
124	301015	百洋医药	2,529,647.00	2.12

125	000572	海马汽车	2,503,608.00	2.10
126	688311	盟升电子	2,481,625.28	2.08
127	600699	均胜电子	2,469,808.00	2.07
128	600237	铜峰电子	2,427,623.00	2.04
129	600557	康缘药业	2,389,710.00	2.01
130	300682	朗新科技	2,388,031.00	2.00

#### 8.4.2 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	000821	京山轻机	20,169,593.00	16.92
2	603728	鸣志电器	14,222,542.00	11.93
3	300418	昆仑万维	13,805,621.68	11.58
4	688017	绿的谐波	12,691,638.59	10.65
5	603688	石英股份	12,063,205.00	10.12
6	002558	巨人网络	9,950,802.40	8.35
7	600050	中国联通	9,718,488.00	8.15
8	600963	岳阳林纸	9,360,812.00	7.85
9	002602	世纪华通	9,065,170.00	7.61
10	002049	紫光国微	8,823,283.00	7.40
11	688053	思科瑞	8,823,145.70	7.40
12	688776	国光电气	8,748,065.07	7.34
13	002517	恺英网络	8,535,499.00	7.16
14	002230	科大讯飞	8,348,522.00	7.01
15	300274	阳光电源	8,288,501.00	6.95
16	300502	新易盛	8,269,639.96	6.94
17	601138	工业富联	7,952,881.00	6.67
18	688256	寒武纪	7,837,663.69	6.58
19	300776	帝尔激光	7,829,399.04	6.57
20	300161	华中数控	7,670,709.00	6.44
21	301030	仕净科技	7,539,033.00	6.33
22	300494	盛天网络	7,461,783.00	6.26
23	001223	欧克科技	7,356,492.00	6.17
24	002335	科华数据	7,154,048.30	6.00
25	002555	三七互娱	7,111,821.00	5.97
26	601633	长城汽车	7,014,477.00	5.89
27	300724	捷佳伟创	6,860,105.00	5.76
28	002897	意华股份	6,329,695.00	5.31
29	300115	长盈精密	6,243,031.80	5.24
30	00700	腾讯控股	6,113,055.78	5.13
31	601390	中国中铁	5,896,461.00	4.95
32	300059	东方财富	5,771,853.00	4.84
33	603396	金辰股份	5,514,317.00	4.63

34	600416	湘电股份	5,350,993.00	4.49
35	600326	西藏天路	5,220,065.80	4.38
36	301308	江波龙	5,153,412.24	4.32
37	300033	同花顺	4,926,837.00	4.13
38	300136	信维通信	4,707,002.00	3.95
39	603185	上机数控	4,673,802.84	3.92
40	09868	小鹏汽车-W	4,549,919.49	3.82
41	601127	赛力斯	4,545,365.00	3.81
42	300559	佳发教育	4,543,612.00	3.81
43	600586	金晶科技	4,495,742.00	3.77
44	002292	奥飞娱乐	4,441,384.00	3.73
45	002121	科陆电子	4,387,437.00	3.68
46	600941	中国移动	4,276,869.00	3.59
47	603359	东珠生态	4,255,146.00	3.57
48	300548	博创科技	4,247,363.00	3.56
49	600760	中航沈飞	4,224,911.00	3.55
50	600481	双良节能	4,196,888.00	3.52
51	000663	永安林业	4,064,465.00	3.41
52	688015	交控科技	4,053,215.89	3.40
53	301050	雷电微力	4,044,534.00	3.39
54	002425	凯撒文化	4,016,879.00	3.37
55	300474	景嘉微	3,966,774.00	3.33
56	300855	图南股份	3,915,981.00	3.29
57	000032	深桑达 A	3,903,304.00	3.28
58	603606	东方电缆	3,896,597.89	3.27
59	002291	遥望科技	3,876,577.00	3.25
60	688111	金山办公	3,820,185.63	3.21
61	01801	信达生物	3,757,705.38	3.15
62	002459	晶澳科技	3,740,439.00	3.14
63	688630	芯碁微装	3,730,245.75	3.13
64	600895	张江高科	3,691,882.28	3.10
65	002918	蒙娜丽莎	3,655,499.00	3.07
66	688123	聚辰股份	3,647,231.75	3.06
67	603138	海量数据	3,622,409.00	3.04
68	605117	德业股份	3,571,977.00	3.00
69	601728	中国电信	3,564,756.00	2.99
70	002472	双环传动	3,564,394.00	2.99
71	688589	力合微	3,559,787.86	2.99
72	601666	平煤股份	3,538,160.00	2.97
73	002487	大金重工	3,445,960.00	2.89
74	600771	广誉远	3,442,259.41	2.89
75	300608	思特奇	3,437,874.20	2.88
76	688398	赛特新材	3,432,325.00	2.88

77	300604	长川科技	3,420,369.00	2.87
78	603208	江山欧派	3,401,243.00	2.85
79	600702	舍得酒业	3,381,743.00	2.84
80	601799	星宇股份	3,370,200.00	2.83
81	600415	小商品城	3,353,889.00	2.81
82	300144	宋城演艺	3,344,844.00	2.81
83	688636	智明达	3,342,700.54	2.80
84	688187	时代电气	3,320,119.95	2.79
85	601360	三六零	3,290,551.00	2.76
86	300510	金冠股份	3,281,102.00	2.75
87	601595	上海电影	3,265,482.00	2.74
88	000799	酒鬼酒	3,253,634.00	2.73
89	000977	浪潮信息	3,250,343.00	2.73
90	688170	德龙激光	3,189,464.24	2.68
91	002605	姚记科技	3,127,442.00	2.62
92	601336	新华保险	3,068,986.00	2.58
93	000837	秦川机床	3,066,380.00	2.57
94	688378	奥来德	3,057,554.20	2.57
95	600546	山煤国际	3,020,729.00	2.53
96	002869	金溢科技	3,017,279.00	2.53
97	688260	昀冢科技	3,012,189.10	2.53
98	601800	中国交建	3,004,943.00	2.52
99	002414	高德红外	2,949,391.00	2.47
100	300394	天孚通信	2,943,624.00	2.47
101	002873	新天药业	2,896,403.70	2.43
102	002324	普利特	2,893,747.00	2.43
103	300687	赛意信息	2,867,470.00	2.41
104	688381	帝奥微	2,855,323.03	2.40
105	300811	铂科新材	2,809,200.00	2.36
106	603636	南威软件	2,783,245.00	2.34
107	603260	合盛硅业	2,760,174.00	2.32
108	002149	西部材料	2,751,233.00	2.31
109	600114	东睦股份	2,751,079.00	2.31
110	300253	卫宁健康	2,696,881.00	2.26
111	300990	同飞股份	2,692,842.00	2.26
112	301015	百洋医药	2,636,094.00	2.21
113	301239	普瑞眼科	2,610,837.00	2.19
114	00285	比亚迪电子	2,591,359.92	2.17
115	605111	新洁能	2,557,949.00	2.15
116	603915	国茂股份	2,527,559.00	2.12
117	002572	索菲亚	2,523,005.00	2.12
118	605128	上海沿浦	2,519,890.00	2.11
119	688472	阿特斯	2,493,266.37	2.09

120	300364	中文在线	2,455,379.84	2.06
121	603596	伯特利	2,447,728.00	2.05
122	600237	铜峰电子	2,434,434.00	2.04
123	603108	润达医疗	2,397,211.00	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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	747,654,760.10
卖出股票收入（成交）总额	751,002,940.56

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。



## 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体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。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	145,155.02
2	应收清算款	536,636.64
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	116,316.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	798,108.02

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.12.6 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，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)

1,965	73,885.59	22,448,323.16	15.46	122,736,856.02	84.54
-------	-----------	---------------	-------	----------------	-------

## 9.2 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	3,108,741.20	2.14

## 9.3 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	22,448,323.16	15.46	8,001,800.00	3.45	36个月
基金管理人高级管理人员					
基金经理等人员	2,001,350.00	1.38	2,001,350.00	0.86	36个月
基金管理人股东					
其他					
合计	24,449,673.16	16.84	10,003,150.00	4.32	36个月

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年9月8日）基金 份额总额	231,705,288.48
本报告期期初基金份额总额	151,728,850.39
本报告期基金总申购份额	25,292,020.60
减：本报告期基金总赎回份额	31,835,691.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	145,185,179.18

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 2 月 23 日发布公告，胡捷先生自 2023 年 2 月 23 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 4 月 7 日发布公告，朱绍纲先生自 2023 年 4 月 4 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 7 月 3 日发布公告，郑鹏先生自 2023 年 5 月 16 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部风险总监。

本报告期内，本基金托管人 2023 年 7 月 27 日发布公告，国然女士自 2023 年 7 月 18 日起不再担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东北证券	2	650,892,784.59	96.12	469,132.79	96.11	-
长江证券	1	26,258,012.41	3.88	19,002.77	3.89	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
东北证券	34,808,385.99	100.00	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	红土创新基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京雪球基金销售有限公司申购起点金额的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023年3月21日
2	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023年4月21日
3	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023年4月27日
4	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金为销售机	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本	2023年5月10日

	构的公告	公司网站	
5	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金在国信证券暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 5 月 25 日
6	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金财富为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 6 月 2 日
7	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新兰德为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 6 月 14 日
8	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 6 月 19 日
9	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长江证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 6 月 26 日
10	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 6 月 27 日
11	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰期货为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 6 月 29 日
12	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增博时财富为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 18 日
13	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 18 日
14	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东吴证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 7 月 24 日
15	红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 8 月 15 日
16	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 8 月 22 日
17	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增粤开证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 8 月 25 日
18	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 9 月 4 日
19	红土创新基金管理有限公司关于暂停	中国证监会基金电子披	2023 年 11 月 30 日

	扬州国信嘉利基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	露网站、规定报社及本公司网站	
20	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 13 日
21	红土创新基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日
22	红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日
23	红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金托管协议（更新）	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日
24	红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）2023 年第 1 期	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日
25	红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2023 年 12 月 29 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- (2) 红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金合同；
- (3) 红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金托管协议；
- (4) 红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- (6) 报告期内红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

### 13.3 查阅方式

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

红土创新基金管理有限公司

2024年3月29日