

红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型
证券投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|--|---------------------|
| 基金简称 | 红土创新科技创新 3 个月定开混合 | |
| 基金主代码 | 009467 | |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 3 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 165,896,552.21 份 | |
| 投资目标 | 本基金主要投资于科技创新主题的上市公司发行的股票，精选具备较高流动性和市值代表性、具有核心成长能力的优质公司。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同投资策略。 (一) 封闭期投资策略：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、其他金融工具投资策略； (二) 开放期投资策略 | |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*70%+中证全债指数收益率*30%。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 | |
| 基金管理人 | 红土创新基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 红土创新科技创新 3 个月定开混合 A | 红土创新科技创新 3 个月定开混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009467 | 013173 |

| | | |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 129,635,147.16 份 | 36,261,405.05 份 |
|-----------------|------------------|-----------------|

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------------|
| | 红土创新科技创新 3 个月定开混合 A | 红土创新科技创新 3 个月定开混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -1,803,954.27 | -520,329.55 |
| 2. 本期利润 | 6,066,085.64 | 1,662,574.69 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0461 | 0.0452 |
| 4. 期末基金资产净值 | 89,796,438.26 | 24,830,972.80 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.6927 | 0.6848 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后得余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

红土创新科技创新 3 个月定开混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 7.28% | 2.55% | 15.45% | 1.53% | -8.17% | 1.02% |
| 过去六个月 | 2.38% | 2.20% | 10.72% | 1.24% | -8.34% | 0.96% |
| 过去一年 | -3.98% | 2.20% | 2.02% | 1.14% | -6.00% | 1.06% |
| 自基金合同生效起至今 | -30.73% | 2.01% | -32.63% | 1.07% | 1.90% | 0.94% |

红土创新科技创新 3 个月定开混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

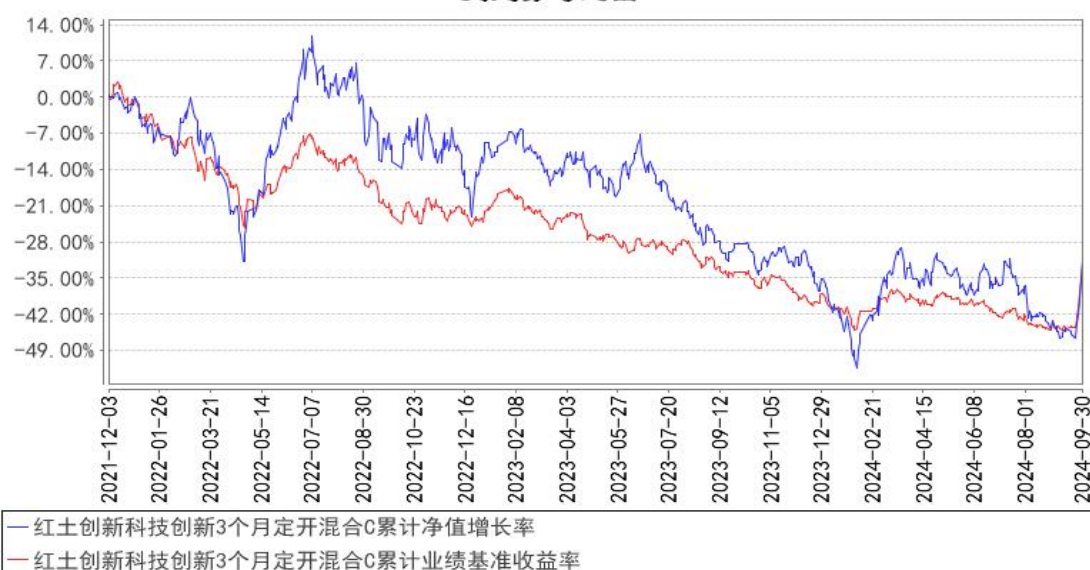
| | | | | ④ | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 7.17% | 2.55% | 15.45% | 1.53% | -8.28% | 1.02% |
| 过去六个月 | 2.16% | 2.20% | 10.72% | 1.24% | -8.56% | 0.96% |
| 过去一年 | -4.37% | 2.20% | 2.02% | 1.14% | -6.39% | 1.06% |
| 自基金合同生效起至今 | -31.52% | 2.01% | -32.63% | 1.07% | 1.11% | 0.94% |

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

红土创新科技创新3个月定开混合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



红土创新科技创新3个月定开混合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：1、本基金基金合同于 2021 年 12 月 3 日正式生效，截至报告期末已满一年；

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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----------|----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 赵波 | 本基金的基金经理 | 2024 年 2 月 7 日 | - | 16 年 | 伦敦大学皇家霍洛威学院理学学士、英国城市大学卡斯商学院理学硕士、中国社会科学院经济学博士。历任中银国际证券有限责任公司高级分析员，长城基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、基金经理，招商证券资产管理有限公司基金经理。现任本公司红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金、红土创新智能制造混合型发起式证券投资基金基金经理。 |

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

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

4.1.1 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、《红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有

人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在不公平交易及异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度市场受到经济持续疲软影响，大部分时间都是缩量下跌，市场信心从春节后的反弹再次跌入谷底，悲观的担心今年 5% 的增长目标可能无法完成。但 9 月最后一周，市场情绪发生反转，政府开始更加积极的释放流动性和化债，增强 4 季度财政发力完成 5% 经济增长的决心，整个市场也开始活跃，成交量持续的放大并创出近几年的历史新高，指数快速反弹。迅速收回 3000 点最终定格在 3300 点。

截止三季度末，本产品也跟随市场反弹，由于科技主题具有更强的弹性，也在这轮反弹中取得比指数更好的收益，但是本轮反弹跟公司基本面无关，而是对宏观悲观预期的一次修复。展望四季度，市场的疯涨很难持续，很快会从普涨回到个股或者板块行情阶段，科技中 AI 仍然是基本面最强和未来科技发展的重要方向，本产品的配置延续了二季度的主要方向，增加了政府化债等基本面边际改善方向的投资布局。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红土创新科技创新 3 个月定开混合 A 的基金份额净值为 0.6927 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.28%；截至本报告期末红土创新科技创新 3 个月定开混合 C 的基金份额净值为 0.6848 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.17%。同期业绩比较基准收益率为 15.45%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 108,457,907.66 | 94.41 |
| | 其中：股票 | 108,457,907.66 | 94.41 |
| 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 | 6,417,380.65 | 5.59 |
| 8 | 其他资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 114,875,288.31 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 93,828,147.66 | 81.85 |
| 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 | 8,908,720.00 | 7.77 |
| J | 金融业 | 1,804,050.00 | 1.57 |
| 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 | 3,916,990.00 | 3.42 |
| 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 | 108,457,907.66 | 94.62 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 300502 | 新易盛 | 64,000 | 8,318,080.00 | 7.26 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 52,000 | 8,052,720.00 | 7.03 |
| 3 | 002463 | 沪电股份 | 170,000 | 6,827,200.00 | 5.96 |
| 4 | 688256 | 寒武纪 | 20,000 | 5,783,200.00 | 5.05 |
| 5 | 688041 | 海光信息 | 44,000 | 4,544,320.00 | 3.96 |
| 6 | 688472 | 阿特斯 | 324,000 | 4,526,280.00 | 3.95 |
| 7 | 300763 | 锦浪科技 | 52,000 | 4,326,400.00 | 3.77 |
| 8 | 002475 | 立讯精密 | 90,000 | 3,911,400.00 | 3.41 |
| 9 | 002085 | 万丰奥威 | 230,000 | 3,479,900.00 | 3.04 |
| 10 | 300394 | 天孚通信 | 34,000 | 3,417,000.00 | 2.98 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编辑日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

无。

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 红土创新科技创新3个月定 | 红土创新科技创新3个月 |
|----|--------------|-------------|
|----|--------------|-------------|

| | 开混合 A | 定开混合 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 135,413,553.85 | 37,890,481.20 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 66,021.86 | 73,931.79 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 5,844,428.55 | 1,703,007.94 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 129,635,147.16 | 36,261,405.05 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 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合同
- (3) 红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 报告期内红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人红土创新基金管理有限公司，客户服务电话：4000603333（免长途话费）

红土创新基金管理有限公司

2024 年 10 月 25 日