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 年年度报告

2024 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 27 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。安永华明会计师事务所（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 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10

§4 管理人报告 11

4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 14

§6 审计报告 15

6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 15

§7 年度财务报表 17

7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 18
7.3 净资产变动表 19
7.4 报表附注 21

§8 投资组合报告 49

8.1 期末基金资产组合情况 49

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 49
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 50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 57
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 57
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 57
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 57
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 57
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
8.12 投资组合报告附注 57

§9 基金份额持有人信息 58

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 58
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 59
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 59

§10 开放式基金份额变动 59

§11 重大事件揭示 60

11.1 基金份额持有人大会决议 60
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 60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 60
11.4 基金投资策略的改变 60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 60
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 60
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 61

§12 影响投资者决策的其他重要信息 64

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 64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 64

§13 备查文件目录 64

13.1 备查文件目录 64
13.2 存放地点 64
13.3 查阅方式 64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	157,058,190.85 份	
基金合同存续期	不定期	
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	124,170,940.14 份	32,887,250.71 份

2.2 基金产品说明

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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	殷喆	方圆
	联系电话	0755-33011858	95559
	电子邮箱	yinz@htcxfund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		0755-33011866	95559
传真		0755-33011855	021-62701216

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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 48 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	阮菲	任德奇

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htcxfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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	2024 年		2023 年		2022 年	
	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	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	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
本期已实现收益	-5,391,397.32	-1,546,329.19	-26,853,357.04	-7,082,552.87	-24,826,415.50	-8,988,210.45
本期利润	9,036,578.23	2,536,878.22	-33,696,406.73	-8,928,175.65	-25,369,431.92	-8,311,311.57
加权平均基金份额本期利润	0.0674	0.0685	-0.1935	-0.1942	-0.1126	-0.1199
本期	10.34%	10.63%	-23.94%	-24.18%	-12.18%	-13.01%

加权平均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	10.28%	9.86%	-23.55%	-23.86%	-14.64%	-14.99%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	-39,190,174.93	-10,653,182.04	-50,279,471.36	-13,815,711.40	-27,358,540.25	-7,561,622.59
期末可供分配基金份额利润	-0.3156	-0.3239	-0.3461	-0.3517	-0.1447	-0.1485
期末基金资产净值	89,539,820.94	23,421,683.01	94,977,431.03	25,470,397.51	161,747,925.45	43,359,255.37
期末基金份额净值	0.7211	0.7122	0.6539	0.6483	0.8553	0.8515
3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	-27.89%	-28.78%	-34.61%	-35.17%	-14.47%	-14.85%

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

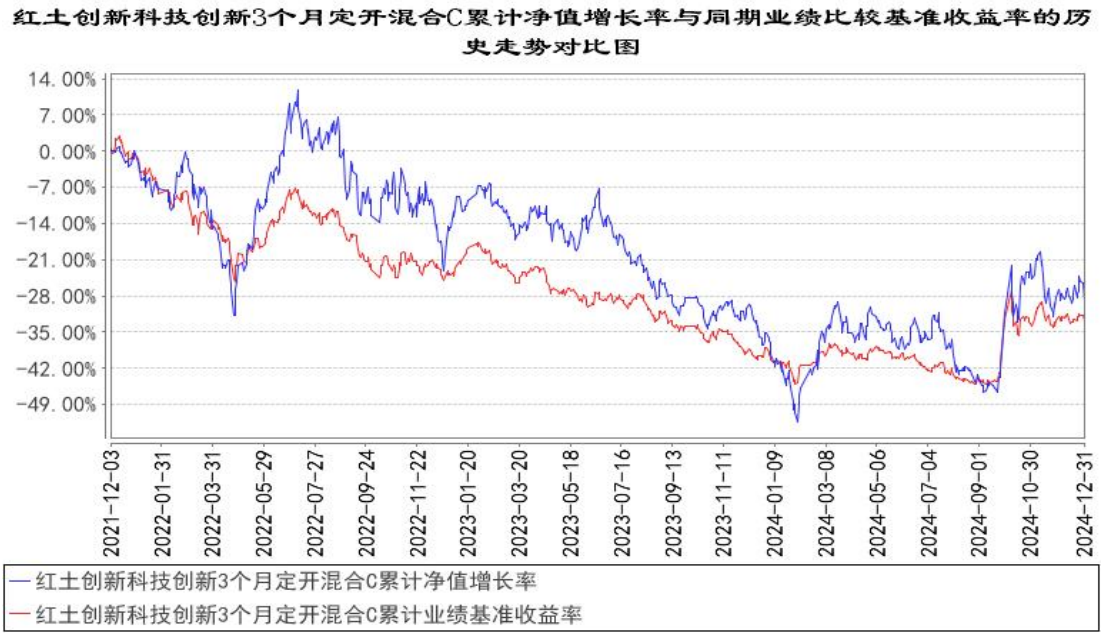
红土创新科技创新 3 个月定开混合 A

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
过去三个月	4.10%	3.16%	-0.39%	1.87%	4.49%	1.29%
过去六个月	11.68%	2.85%	14.99%	1.70%	-3.31%	1.15%
过去一年	10.28%	2.63%	8.27%	1.41%	2.01%	1.22%
过去三年	-28.03%	2.15%	-32.71%	1.16%	4.68%	0.99%
自基金合同生效起至今	-27.89%	2.12%	-32.90%	1.15%	5.01%	0.97%

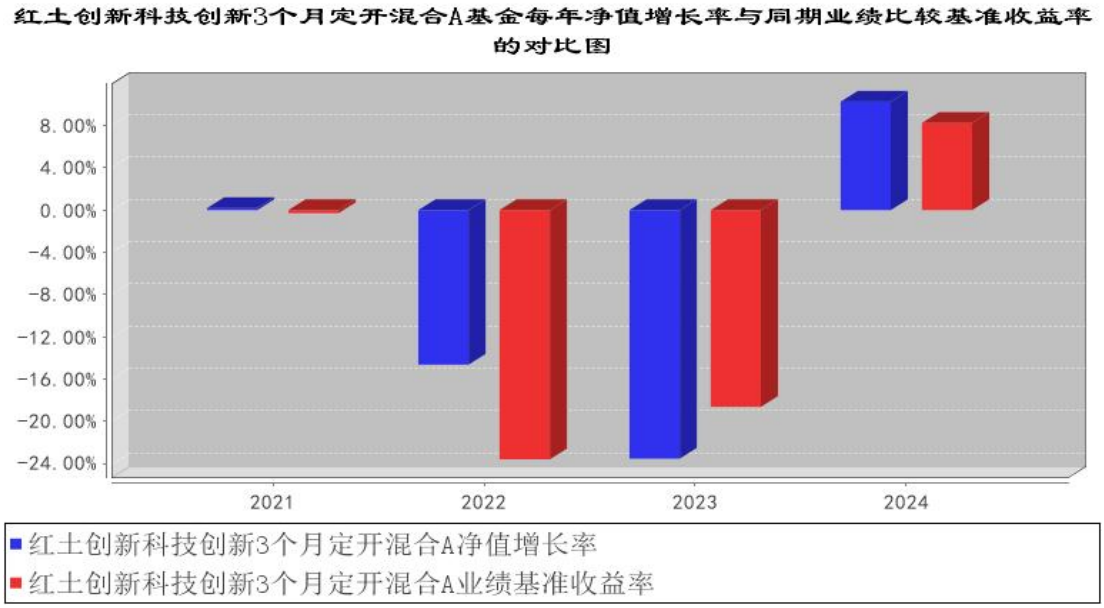
红土创新科技创新 3 个月定开混合 C

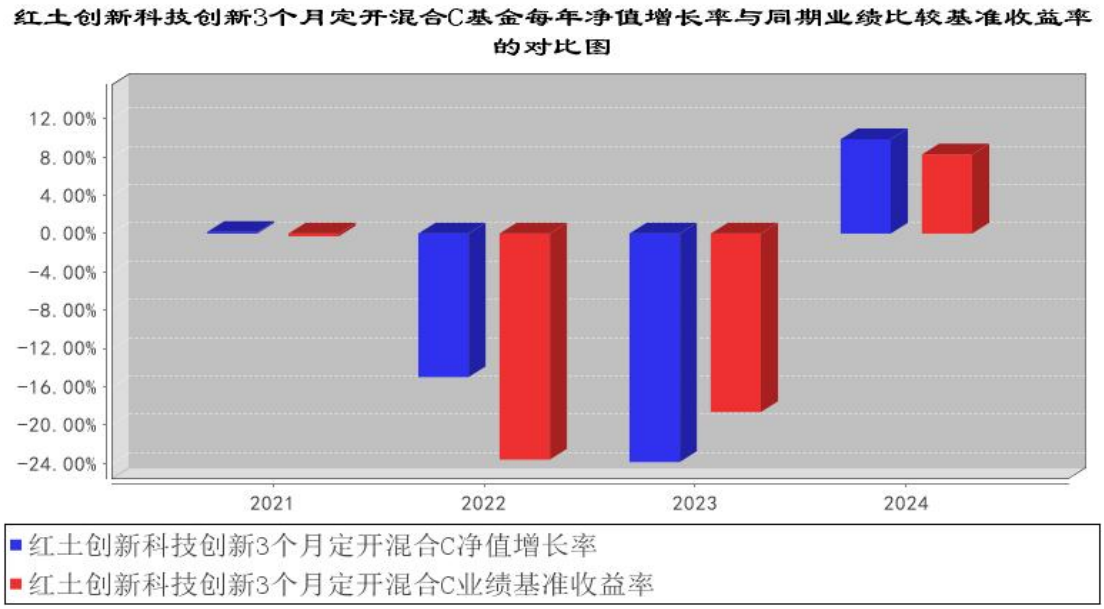
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	4.00%	3.16%	-0.39%	1.87%	4.39%	1.29%
过去六个月	11.46%	2.85%	14.99%	1.70%	-3.53%	1.15%
过去一年	9.86%	2.63%	8.27%	1.41%	1.59%	1.22%
过去三年	-28.90%	2.15%	-32.71%	1.16%	3.81%	0.99%
自基金合同生效起至今	-28.78%	2.12%	-32.90%	1.15%	4.12%	0.97%

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



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





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 5.5 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 2024 年 12 月 31 日，红土创新基金共管理 23 只公募基金，资产管理规模 252.82 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		
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。
盖俊龙	本基金的基金经理	2021 年 12 月 3 日	2024 年 2 月 7 日	18 年	历任长城基金管理有限公司行业研究员；宝盈基金管理有限公司研究员、专户投资经理、基金经理。现任本公司投资部总监，红土创新转型精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、红土创新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。

4.1.3 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 2024 年，市场延续了 2023 年的悲观预期，中美贸易战持续，以及地产衰退的势头仍然未见起色，市场也是在前三个季度表现低迷。但随着 9 月份政策回暖以及对资本市场的关注度增加，地产以及地方债的救助政策的逐步落实，市场迎来较大反弹，悲观预期得到较大的修复，从板块上来看红利仍然是贯穿全年的主线，科技仍然集中在海外映射的 AI 硬件为主，其他方向仍然没有主线，持续的调整。传统周期行业虽然在 9 月-10 月份迎来悲观预期修复的行情，全年下来仍然那下跌较多。

4.4.2 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 基金份额净值为 0.7211 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.28%；红土创新科技创新 3 个月定开混合 C 基金份额净值为 0.7122 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.86%，同期业绩比较基准收益率为 8.27%。

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 2025 年，随着政策的逐步落实，经济增长的悲观预期逐步修正，但恢复速度较慢，可能下半年才能看到消费数据的回暖和地产链的复苏。但资本市场经过去年的反弹行情，交易量上升，已经早于经济回暖，市场的风险偏好提高，科技在 chatgpt 发布后进入了快车道，中国科技研发的虽然落后于美国但紧紧跟随并未拉开差距，但相关股票的走势上中国受到中美竞争的影响明显被低估，随着中国科技成果的展示，这个估值差距会在今年收敛，因此今年会更关注中国的 AI 相关公司以及相关变化，另外相关的 AI 应用中国公司更有优势，重点关注机器人、智能驾驶和 AI agent。

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

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，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

本报告期内，红土创新基金管理有限公司在红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由红土创新基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务

会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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	安永华明（2025）审字第 80012138_H05 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	红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金（以下简称“红土创新科技创新 3 个月定开混合”）的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的红土创新科技创新 3 个月定开混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了红土创新科技创新 3 个月定开混合 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于红土创新科技创新 3 个月定开混合，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	红土创新科技创新 3 个月定开混合管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。 在编制财务报表时，管理层负责评估红土创新科技创新 3 个

	月定开混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督红土创新科技创新3个月定开混合的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （1）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。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价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。 （4）对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科技创新3个月定开混合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科技创新3个月定开混合不能持续经营。 （5）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。 我们与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。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	高 鹤 / 林恩丽
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2025年3月28日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	6,877.99	1,181,336.34
结算备付金		7,257,047.29	17,670,939.27
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	106,017,371.00	103,108,839.32
其中：股票投资		106,017,371.00	103,108,839.32
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	12,729.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		113,281,296.28	121,973,844.41
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 日**	**上年度末 2023 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		-	-

应付赎回款		-	1,139,670.99
应付管理人报酬		117,165.80	168,787.17
应付托管费		19,527.63	28,131.18
应付销售服务费		8,098.90	9,426.53
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	175,000.00	180,000.00
负债合计		319,792.33	1,526,015.87
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	157,058,190.85	184,543,011.30
未分配利润	7.4.7.12	-44,096,686.90	-64,095,182.76
净资产合计		112,961,503.95	120,447,828.54
负债和净资产总计		113,281,296.28	121,973,844.41

注： 报告截止日2024年12月31日，基金份额总额157,058,190.85份，其中，A类基金份额净值0.7211元，基金份额124,170,940.14份；C类基金份额净值0.7122元，基金份额32,887,250.71份。

7.2 利润表

会计主体：红土创新科技创新3个月定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
一、营业总收入		13,397,989.41	-39,172,627.05
1.利息收入		14,950.78	59,149.68
其中：存款利息收入	7.4.7.13	14,950.78	59,149.68
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）		-5,130,883.08	-30,543,254.95
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-5,870,953.51	-30,893,509.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-826,305.75
资产支持证券投资收益	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	740,070.43	1,176,560.28
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	18,511,182.96	-8,688,672.47
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	2,738.75	150.69
减：二、营业总支出		1,824,532.96	3,451,955.33
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	1,331,967.68	2,677,062.27
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	221,994.65	446,177.02
3．销售服务费	7.4.10.2.3	95,262.16	148,430.14
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		-	50.90
8．其他费用	7.4.7.23	175,308.47	180,235.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,573,456.45	-42,624,582.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,573,456.45	-42,624,582.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,573,456.45	-42,624,582.38

7.3 净资产变动表

会计主体：红土创新科技创新3个月定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024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	184,543,011.30	-	-64,095,182.76	120,447,828.54
二、本期期初净资产	184,543,011.30	-	-64,095,182.76	120,447,828.54
三、本期增减变	-27,484,820.45	-	19,998,495.86	-7,486,324.59

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	11,573,456.45	11,573,456.45
（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）	-27,484,820.45	-	8,425,039.41	-19,059,781.04
其中：1.基金申购款	1,292,712.44	-	-345,956.73	946,755.71
2.基金赎回款	-28,777,532.89	-	8,770,996.14	-20,006,536.75
（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	157,058,190.85	-	-44,096,686.90	112,961,503.95

项目	上年度可比期间 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	240,027,343.66	-	-34,920,162.84	205,107,180.82
二、本期期初净资产	240,027,343.66	-	-34,920,162.84	205,107,180.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-55,484,332.36	-	-29,175,019.92	-84,659,352.28
（一）、综合收益总额	-	-	-42,624,582.38	-42,624,582.38
（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）	-55,484,332.36	-	13,449,562.46	-42,034,769.90
其中：1.基金申购款	1,725,580.70	-	-301,968.51	1,423,612.19
2.基金赎回款	-57,209,913.06	-	13,751,530.97	-43,458,382.09
（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	184,543,011.30	-	-64,095,182.76	120,447,828.54

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

红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]446 号《关于准予红土创新科技创新三个月滚动持有混合型证券投资基金注册的批复》及证监许可[2021]2030 号《关于准予红土创新科技创新三个月滚动持有混合型证券投资基金变更注册的批复》核准，由红土创新基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 374,919,643.91 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 1132 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 374,964,605.65 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,961.74 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金以每个封闭期为周期进行投资运作，每个封闭期为 3 个月。本基金的封闭期自基金合同生效日起(包括该日)或每一个开放期结束之日的次日起(包括该日)至 3 个月后对日的前一日(包括该日)的期间。本基金在封闭期内不接受申购、赎回、转换转入、转换转出等交易申请。本基金自每个封闭期结束之后第一个工作日起(包括该日)进入开放期，期间可以办理申购与赎回等业务。根据《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》，本基金根据认购、申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，不计提销售服务费的，称为 A 类基

金份额；在投资者认购、申购时不收取前端认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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)。封闭期内，本基金的股票及存托凭证投资比例占基金资产的 60-95%，投资于科创主题的证券资产比例不低于非现金基金资产的 80%；但在每次开放期前 5 个工作日、开放期及开放期结束后 5 个工作日的期间内，不受前述投资组合比例的限制。封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。开放期内，每个交易日日终在扣除股指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、存出保证金及应收申购款等。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%。

本财务报表已于 2025 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准报出。

7.4.2 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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 2024 年 12 月 31 日的财

务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期

信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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）不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值。

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

本基金同一类别的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。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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 分部报告

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）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）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。 本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

（1）增值税及附加

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征增值税试点的通知》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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

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。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《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》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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，（如有）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，（如有）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。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变； 根据财政部、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》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	6,877.99	1,181,336.34
等于：本金	6,877.77	1,181,267.86
加：应计利息	0.22	68.48
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	6,877.99	1,181,336.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		88,036,914.53	-	106,017,371.00	17,980,456.47
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		88,036,914.53	-	106,017,371.00	17,980,456.47
项目		上年度末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		103,639,565.81	-	103,108,839.32	-530,726.49
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		103,639,565.81	-	103,108,839.32	-530,726.49

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	175,000.00	180,000.00
合计	175,000.00	180,000.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

红土创新科技创新 3 个月定开混合 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	145,256,902.39	145,256,902.39
本期申购	697,480.21	697,480.21
本期赎回（以“-”号填列）	-21,783,442.46	-21,783,442.46
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	124,170,940.14	124,170,940.14

红土创新科技创新 3 个月定开混合 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,286,108.91	39,286,108.91
本期申购	595,232.23	595,232.23
本期赎回（以“-”号填列）	-6,994,090.43	-6,994,090.43
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	32,887,250.71	32,887,250.71

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）、级别调整入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

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

红土创新科技创新 3 个月定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-41,214,552.48	-9,064,918.88	-50,279,471.36
本期期初	-41,214,552.48	-9,064,918.88	-50,279,471.36
本期利润	-5,391,397.32	14,427,975.55	9,036,578.23
本期基金份额交易产生的变动数	7,415,774.87	-804,000.94	6,611,773.93
其中：基金申购款	-229,683.71	50,339.82	-179,343.89
基金赎回款	7,645,458.58	-854,340.76	6,791,117.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-39,190,174.93	4,559,055.73	-34,631,119.20

红土创新科技创新 3 个月定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-11,376,519.95	-2,439,191.45	-13,815,711.40
本期期初	-11,376,519.95	-2,439,191.45	-13,815,711.40
本期利润	-1,546,329.19	4,083,207.41	2,536,878.22
本期基金份额交易产生的变动数	2,269,667.10	-456,401.62	1,813,265.48
其中：基金申购款	-194,323.00	27,710.16	-166,612.84
基金赎回款	2,463,990.10	-484,111.78	1,979,878.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,653,182.04	1,187,614.34	-9,465,567.70

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	432.49	1,406.38
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	14,518.29	57,743.30

其他	-	-
合计	14,950.78	59,149.68

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,870,953.51	-30,893,509.48
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	-5,870,953.51	-30,893,509.48

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	805,878,939.36	1,285,248,753.90
减：卖出股票成本总额	810,373,275.21	1,313,337,670.69
减：交易费用	1,376,617.66	2,804,592.69
买卖股票差价收入	-5,870,953.51	-30,893,509.48

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日

债券投资收益——利息收入	-	14,138.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-840,443.89
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	-	-826,305.75

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	26,432,539.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	27,238,850.11
减：应计利息总额	-	31,982.67
减：交易费用	-	2,150.11
买卖债券差价收入	-	-840,443.89

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	740,070.43	1,176,560.28
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	740,070.43	1,176,560.28

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日

1.交易性金融资产	18,511,182.96	-8,688,672.47
股票投资	18,511,182.96	-8,688,672.47
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	18,511,182.96	-8,688,672.47

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	2,731.22	146.63
基金转换费收入	7.53	4.06
合计	2,738.75	150.69

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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	130.00	235.00
存托服务费	178.47	-
合计	175,308.47	180,235.00

7.4.7.24 分部报告

截至本报告期末，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。

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

无。

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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,331,967.68	2,677,062.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	591,798.99	1,203,608.07
应支付基金管理人的净管理费	740,168.69	1,473,454.20

注：（1）基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.20%/当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

（2）本基金自 2024 年 1 月 1 日起，基金管理费的年费率由 1.50%调整为 1.20%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	221,994.65	446,177.02

注：（1）基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

（2）本基金自 2024 年 1 月 1 日起，基金托管费的年费率由 0.25%调整为 0.20%。

7.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红土创新科技创新 3	红土创新科技创新 3	合计

	个月定开混合A	个月定开混合C	
交通银行	-	20,766.96	20,766.96
红土创新	-	4,033.30	4,033.30
合计	-	24,800.26	24,800.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
交通银行	-	28,484.11	28,484.11
红土创新	-	5,583.68	5,583.68
合计	-	34,067.79	34,067.79

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给红土创新基金，再由红土创新基金计算并支付给各基金销售机构。

H=E×0.40%/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

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固有资金投资本基金的情况

无。

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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
交通银行	6,877.99	432.49	1,181,336.34	1,406.38

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

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（2024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，理论上其预期风险收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金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 2024 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2023 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约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、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间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。

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 2024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	6,877.99	-	-	-	6,877.99
结算备付金	7,257,047.29	-	-	-	7,257,047.29

交易性金融资产	-	-	-	106,017,371.00	106,017,371.00
资产总计	7,263,925.28	-	-	106,017,371.00	113,281,296.28
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	117,165.80	117,165.80
应付托管费	-	-	-	19,527.63	19,527.63
应付销售服务费	-	-	-	8,098.90	8,098.90
其他负债	-	-	-	175,000.00	175,000.00
负债总计	-	-	-	319,792.33	319,792.33
利率敏感度缺口	7,263,925.28	-	-	105,697,578.67	112,961,503.95
上年度末 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	1,181,336.34	-	-	-	1,181,336.34
结算备付金	17,670,939.27	-	-	-	17,670,939.27
交易性金融资产	-	-	-	103,108,839.32	103,108,839.32
应收申购款	-	-	-	12,729.48	12,729.48
资产总计	18,852,275.61	-	-	103,121,568.80	121,973,844.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,139,670.99	1,139,670.99
应付管理人报酬	-	-	-	168,787.17	168,787.17
应付托管费	-	-	-	28,131.18	28,131.18
应付销售服务费	-	-	-	9,426.53	9,426.53
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,526,015.87	1,526,015.87
利率敏感度缺口	18,852,275.61	-	-	101,595,552.93	120,447,828.54

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2024年12月31日，本基金未持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资（2023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（2023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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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 2024年12月31日		上年度末 2023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	106,017,371.00	93.85	103,108,839.32	85.60
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	106,017,371.00	93.85	103,108,839.32	85.60

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)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（2024年12月31日）	上年度末 （2023年12月31日 ）
	1.业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	4,479,252.45	8,362,021.81
	2.业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-4,479,252.45	-8,362,021.81

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	106,017,371.00	103,108,839.32
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	106,017,371.00	103,108,839.32

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
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 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	-	790,723.58	790,723.58
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	54,081.96	54,081.96
转出第三层次	-	1,324,145.37	1,324,145.37
当期利得或损失总额	-	479,339.83	479,339.83
其中：计入损益的利得或损失	-	479,339.83	479,339.83
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	-	-	-

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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	106,017,371.00	93.59
	其中：股票	106,017,371.00	93.59
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	7,263,925.28	6.41
8	其他各项资产	-	-
9	合计	113,281,296.28	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	87,482,541.00	77.44
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	2,544,030.00	2.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,977,000.00	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,628,300.00	10.29
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	2,385,500.00	2.11
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	106,017,371.00	93.85

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	688256	寒武纪	12,700	8,356,600.00	7.40
2	688183	生益电子	140,000	5,496,400.00	4.87
3	688041	海光信息	36,000	5,392,440.00	4.77
4	002916	深南电路	43,000	5,375,000.00	4.76
5	300502	新易盛	40,000	4,623,200.00	4.09
6	300548	博创科技	99,000	4,594,590.00	4.07
7	300570	太辰光	63,000	4,580,100.00	4.05
8	002463	沪电股份	115,000	4,559,750.00	4.04
9	300757	罗博特科	18,600	4,190,952.00	3.71
10	002085	万丰奥威	207,000	3,922,650.00	3.47
11	603986	兆易创新	36,000	3,844,800.00	3.40
12	300476	胜宏科技	80,000	3,367,200.00	2.98
13	002281	光迅科技	63,000	3,286,710.00	2.91
14	300308	中际旭创	25,000	3,087,750.00	2.73
15	688018	乐鑫科技	13,000	2,834,000.00	2.51
16	688981	中芯国际	29,000	2,743,980.00	2.43
17	002241	歌尔股份	100,000	2,581,000.00	2.28
18	300783	三只松鼠	69,000	2,544,030.00	2.25
19	002130	沃尔核材	100,000	2,525,000.00	2.24
20	603662	柯力传感	38,000	2,454,800.00	2.17
21	301091	深城交	50,000	2,385,500.00	2.11
22	300580	贝斯特	99,000	2,272,050.00	2.01
23	601231	环旭电子	135,000	2,227,500.00	1.97

24	688608	恒玄科技	6,700	2,179,979.00	1.93
25	688205	德科立	23,000	2,093,000.00	1.85
26	000099	中信海直	75,000	1,977,000.00	1.75
27	688332	中科蓝讯	15,000	1,957,500.00	1.73
28	688698	伟创电气	29,930	1,316,920.00	1.17
29	002429	兆驰股份	220,000	1,271,600.00	1.13
30	600104	上汽集团	56,000	1,162,560.00	1.03
31	600580	卧龙电驱	65,000	1,117,350.00	0.99
32	002851	麦格米特	18,000	1,106,280.00	0.98
33	300394	天孚通信	10,000	913,600.00	0.81
34	688313	仕佳光子	30,000	491,700.00	0.44
35	300913	兆龙互连	8,000	460,080.00	0.41
36	300383	光环新网	30,000	437,700.00	0.39
37	000988	华工科技	10,000	433,000.00	0.38
38	002353	杰瑞股份	10,000	369,900.00	0.33
39	600889	南京化纤	20,000	355,200.00	0.31
40	603296	华勤技术	5,000	354,750.00	0.31
41	300762	上海瀚讯	15,000	315,450.00	0.28
42	300121	阳谷华泰	20,000	241,800.00	0.21
43	300629	新劲刚	10,000	216,000.00	0.19

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	300394	天孚通信	15,295,512.00	12.70
2	300570	太辰光	13,935,943.00	11.57
3	002916	深南电路	13,081,758.00	10.86
4	688631	莱斯信息	10,004,338.25	8.31
5	300476	胜宏科技	9,280,626.92	7.71
6	002371	北方华创	9,266,710.00	7.69
7	300857	协创数据	8,785,032.00	7.29
8	002865	钧达股份	8,765,488.20	7.28
9	688041	海光信息	8,668,083.13	7.20
10	002130	沃尔核材	8,565,243.00	7.11
11	002281	光迅科技	7,949,821.00	6.60
12	300762	上海瀚讯	7,788,038.00	6.47
13	001309	德明利	7,776,263.00	6.46
14	688981	中芯国际	7,696,140.86	6.39
15	688498	源杰科技	7,420,734.05	6.16
16	688037	芯源微	6,998,482.52	5.81
17	300573	兴齐眼药	6,606,902.00	5.49

18	603986	兆易创新	6,495,176.00	5.39
19	001696	宗申动力	6,482,850.00	5.38
20	688183	生益电子	6,377,676.78	5.29
21	601138	工业富联	6,213,475.00	5.16
22	300757	罗博特科	6,052,313.40	5.02
23	300308	中际旭创	6,045,810.00	5.02
24	002384	东山精密	5,865,971.00	4.87
25	688717	艾罗能源	5,812,773.64	4.83
26	002085	万丰奥威	5,802,445.00	4.82
27	601127	赛力斯	5,792,472.00	4.81
28	688472	阿特斯	5,790,236.60	4.81
29	002273	水晶光电	5,616,200.00	4.66
30	603283	赛腾股份	5,467,023.68	4.54
31	600438	通威股份	5,298,528.00	4.40
32	601766	中国中车	5,219,389.00	4.33
33	300017	网宿科技	5,068,943.00	4.21
34	000099	中信海直	4,953,299.00	4.11
35	688256	寒武纪	4,892,550.31	4.06
36	002475	立讯精密	4,865,289.34	4.04
37	300364	中文在线	4,865,099.00	4.04
38	603606	东方电缆	4,853,033.00	4.03
39	002714	牧原股份	4,838,007.00	4.02
40	600580	卧龙电驱	4,606,200.00	3.82
41	689009	九号公司	4,605,331.40	3.82
42	688095	福昕软件	4,593,365.89	3.81
43	600764	中国海防	4,516,853.68	3.75
44	002938	鹏鼎控股	4,504,541.00	3.74
45	300763	锦浪科技	4,322,233.00	3.59
46	300552	万集科技	4,287,636.00	3.56
47	688608	恒玄科技	4,193,696.91	3.48
48	300502	新易盛	4,185,804.00	3.48
49	002594	比亚迪	4,102,103.00	3.41
50	603129	春风动力	4,009,372.00	3.33
51	601567	三星医疗	4,001,946.00	3.32
52	605499	东鹏饮料	3,935,991.00	3.27
53	600114	东睦股份	3,859,356.00	3.20
54	600941	中国移动	3,848,040.00	3.19
55	605296	神农集团	3,792,420.00	3.15
56	601111	中国国航	3,767,675.00	3.13
57	600557	康缘药业	3,748,698.00	3.11
58	301091	深城交	3,743,437.92	3.11
59	300058	蓝色光标	3,717,967.00	3.09
60	688676	金盘科技	3,602,631.47	2.99

61	603486	科沃斯	3,601,396.00	2.99
62	300432	富临精工	3,571,653.88	2.97
63	301308	江波龙	3,535,451.08	2.94
64	688072	拓荆科技	3,349,845.54	2.78
65	000725	京东方A	3,348,700.00	2.78
66	688032	禾迈股份	3,328,687.82	2.76
67	603993	洛阳钼业	3,272,833.00	2.72
68	000977	浪潮信息	3,243,838.00	2.69
69	300496	中科创达	3,240,633.00	2.69
70	603444	吉比特	3,232,153.80	2.68
71	300181	佐力药业	3,191,657.00	2.65
72	603305	旭升集团	3,159,249.60	2.62
73	300446	航天智造	3,150,583.00	2.62
74	688408	中信博	3,144,992.53	2.61
75	300750	宁德时代	3,109,903.00	2.58
76	300133	华策影视	3,091,622.00	2.57
77	300548	博创科技	3,076,867.00	2.55
78	000100	TCL科技	3,017,427.90	2.51
79	301183	东田微	2,993,220.00	2.49
80	600487	亨通光电	2,971,616.00	2.47
81	688018	乐鑫科技	2,966,765.31	2.46
82	603198	迎驾贡酒	2,965,418.00	2.46
83	600160	巨化股份	2,958,168.00	2.46
84	603337	杰克股份	2,956,297.00	2.45
85	300059	东方财富	2,951,050.80	2.45
86	688169	石头科技	2,917,270.18	2.42
87	002705	新宝股份	2,916,766.00	2.42
88	000568	泸州老窖	2,891,220.00	2.40
89	301285	鸿日达	2,888,992.00	2.40
90	601899	紫金矿业	2,833,860.00	2.35
91	688208	道通科技	2,799,827.20	2.32
92	300049	福瑞股份	2,790,273.00	2.32
93	688259	创耀科技	2,785,639.94	2.31
94	600519	贵州茅台	2,779,819.00	2.31
95	600809	山西汾酒	2,767,998.00	2.30
96	300661	圣邦股份	2,727,976.00	2.26
97	300274	阳光电源	2,708,874.00	2.25
98	688076	诺泰生物	2,695,645.05	2.24
99	603009	北特科技	2,665,764.00	2.21
100	002241	歌尔股份	2,658,339.00	2.21
101	002465	海格通信	2,655,064.00	2.20
102	688187	时代电气	2,626,670.94	2.18
103	603662	柯力传感	2,583,698.00	2.15

104	002851	麦格米特	2,539,726.00	2.11
105	300280	紫天科技	2,521,238.00	2.09
106	300783	三只松鼠	2,457,820.00	2.04
107	002625	光启技术	2,454,364.00	2.04
108	603200	上海洗霸	2,440,213.00	2.03

8.4.2 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	300394	天孚通信	16,785,923.01	13.94
2	300570	太辰光	13,815,188.00	11.47
3	300308	中际旭创	12,737,429.20	10.58
4	300502	新易盛	11,141,418.29	9.25
5	688631	莱斯信息	11,084,251.18	9.20
6	002371	北方华创	10,078,891.00	8.37
7	002865	钧达股份	9,765,568.68	8.11
8	002281	光迅科技	9,106,154.00	7.56
9	001309	德明利	8,431,285.10	7.00
10	300857	协创数据	7,925,041.00	6.58
11	300757	罗博特科	7,889,773.00	6.55
12	001696	宗申动力	7,656,927.00	6.36
13	300762	上海瀚讯	7,652,322.00	6.35
14	002916	深南电路	7,514,719.00	6.24
15	000997	新大陆	7,169,288.00	5.95
16	300476	胜宏科技	6,895,888.00	5.73
17	688498	源杰科技	6,854,719.59	5.69
18	688472	阿特斯	6,843,475.53	5.68
19	300573	兴齐眼药	6,353,074.00	5.27
20	002130	沃尔核材	6,303,311.00	5.23
21	688037	芯源微	6,197,121.09	5.15
22	688041	海光信息	6,178,566.92	5.13
23	601127	赛力斯	6,057,839.00	5.03
24	002085	万丰奥威	6,030,661.30	5.01
25	002465	海格通信	5,990,496.00	4.97
26	002384	东山精密	5,875,923.00	4.88
27	601138	工业富联	5,786,644.00	4.80
28	688717	艾罗能源	5,781,881.89	4.80
29	002475	立讯精密	5,570,336.88	4.62
30	300017	网宿科技	5,542,489.00	4.60
31	601766	中国中车	5,291,775.00	4.39
32	002273	水晶光电	5,222,350.00	4.34
33	600438	通威股份	5,191,318.05	4.31
34	603606	东方电缆	5,059,093.00	4.20

35	688095	福昕软件	4,974,818.57	4.13
36	603283	赛腾股份	4,972,850.00	4.13
37	688123	聚辰股份	4,958,451.55	4.12
38	688981	中芯国际	4,848,639.70	4.03
39	300763	锦浪科技	4,795,440.10	3.98
40	300364	中文在线	4,757,701.24	3.95
41	689009	九号公司	4,703,777.73	3.91
42	002714	牧原股份	4,685,587.57	3.89
43	300130	新国都	4,638,563.00	3.85
44	002938	鹏鼎控股	4,566,021.00	3.79
45	688256	寒武纪	4,544,123.70	3.77
46	688270	臻镭科技	4,427,974.63	3.68
47	688183	生益电子	4,394,121.45	3.65
48	601567	三星医疗	4,385,307.00	3.64
49	002463	沪电股份	4,192,327.00	3.48
50	002594	比亚迪	4,106,853.00	3.41
51	600764	中国海防	3,947,439.64	3.28
52	300432	富临精工	3,927,905.34	3.26
53	603009	北特科技	3,914,364.00	3.25
54	605499	东鹏饮料	3,852,233.00	3.20
55	603129	春风动力	3,819,477.00	3.17
56	600941	中国移动	3,795,483.00	3.15
57	000977	浪潮信息	3,721,841.00	3.09
58	601111	中国国航	3,721,175.00	3.09
59	600114	东睦股份	3,715,731.00	3.08
60	605296	神农集团	3,711,853.20	3.08
61	688676	金盘科技	3,704,062.39	3.08
62	301308	江波龙	3,619,110.00	3.00
63	603993	洛阳钼业	3,527,655.00	2.93
64	300552	万集科技	3,522,673.00	2.92
65	300181	佐力药业	3,480,131.00	2.89
66	688032	禾迈股份	3,467,591.84	2.88
67	300058	蓝色光标	3,437,190.00	2.85
68	688048	长光华芯	3,374,601.73	2.80
69	600557	康缘药业	3,311,571.00	2.75
70	603486	科沃斯	3,277,354.00	2.72
71	688008	澜起科技	3,255,070.91	2.70
72	301183	东田微	3,250,139.00	2.70
73	603444	吉比特	3,236,669.00	2.69
74	300274	阳光电源	3,147,023.60	2.61
75	600580	卧龙电驱	3,138,294.00	2.61
76	300133	华策影视	3,136,584.00	2.60
77	000725	京东方A	3,116,000.00	2.59

78	688439	振华风光	3,101,019.97	2.57
79	603712	七一二	3,092,486.00	2.57
80	002705	新宝股份	3,078,667.00	2.56
81	688169	石头科技	3,030,609.00	2.52
82	688072	拓荆科技	3,026,276.76	2.51
83	300049	福瑞股份	3,015,249.00	2.50
84	600809	山西汾酒	2,982,516.00	2.48
85	300446	航天智造	2,943,353.00	2.44
86	301285	鸿日达	2,937,046.00	2.44
87	603198	迎驾贡酒	2,934,956.00	2.44
88	300496	中科创达	2,896,959.00	2.41
89	000100	TCL科技	2,885,700.00	2.40
90	603305	旭升集团	2,884,612.00	2.39
91	300750	宁德时代	2,881,047.00	2.39
92	600519	贵州茅台	2,859,542.00	2.37
93	603337	杰克股份	2,853,854.00	2.37
94	688208	道通科技	2,833,794.67	2.35
95	301091	深城交	2,801,786.64	2.33
96	688408	中信博	2,750,527.68	2.28
97	600487	亨通光电	2,746,511.00	2.28
98	000099	中信海直	2,731,214.00	2.27
99	600160	巨化股份	2,721,823.00	2.26
100	300951	博硕科技	2,721,363.00	2.26
101	301391	卡莱特	2,707,233.00	2.25
102	601899	紫金矿业	2,702,020.00	2.24
103	002625	光启技术	2,665,256.00	2.21
104	000681	视觉中国	2,633,861.00	2.19
105	000568	泸州老窖	2,626,356.00	2.18
106	002558	巨人网络	2,623,211.00	2.18
107	603986	兆易创新	2,607,000.00	2.16
108	600522	中天科技	2,604,515.00	2.16
109	300661	圣邦股份	2,592,166.00	2.15
110	601858	中国科传	2,558,503.00	2.12
111	688187	时代电气	2,538,678.99	2.11
112	300059	东方财富	2,526,262.00	2.10
113	688076	诺泰生物	2,515,504.34	2.09
114	300280	紫天科技	2,502,061.00	2.08
115	603200	上海洗霸	2,482,640.00	2.06
116	000676	智度股份	2,449,172.00	2.03
117	600316	洪都航空	2,418,399.00	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	794,770,623.93
卖出股票收入（成交）总额	805,878,939.36

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，或在报告编辑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

无。

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

份额级别	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（%）
红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	1,818	68,300.85	98,834.23	0.08	124,072,105.91	99.92
红土创新科技创新 3 个月定开混合 C	2,508	13,112.94	100,018.00	0.30	32,787,232.71	99.70
合计	4,271	36,773.17	198,852.23	0.13	156,859,338.62	99.87

9.2 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	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	64,239.77	0.0517

有从业人员持有本基金	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C	550,533.49	1.6740
	合计	614,773.26	0.3914

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	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	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	0~10
	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	0
	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C	0
	合计	0

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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红土创新科技创新 3 个月定开混合 A	红土创新科技创新 3 个月定开混合 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 3 日）基金份额总额	271,603,968.88	103,360,636.77
本报告期期初基金份额总额	145,256,902.39	39,286,108.91
本报告期基金总申购份额	697,480.21	595,232.23
减：本报告期基金总赎回份额	21,783,442.46	6,994,090.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	124,170,940.14	32,887,250.71

§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

2024年2月7日，公司增聘赵波先生为本基金的基金经理，解聘盖俊龙先生的本基金基金经理职务；现赵波先生为本基金唯一基金经理。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本基金聘任安永华明会计师事务所（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，基金管理人及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，基金托管人及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(%)	
招商证券	2	1,600,649,563.29	100.00	871,143.54	100.00	-

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(%)
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型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	2024 年 2 月 9 日
2	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏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	2024 年 3 月 14 日
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开放日常申购（赎回、转换）业务公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 3 月 29 日
4	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安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	2024 年 4 月 3 日
5	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增邮储银行（“邮你同赢”平台）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	2024 年 4 月 8 日
6	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金元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	2024 年 4 月 8 日
7	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东肯特瑞为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 9 日
8	红土创新基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在盈米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	2024 年 4 月 9 日
9	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 10 日
10	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安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	2024 年 4 月 24 日
11	红土创新基金管理有限公司关于谨防不法分子假冒“红土创新基金”名义	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本	2024 年 5 月 7 日

	进行非法活动的声明	公司网站	
12	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富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	2024 年 5 月 17 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挖财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	2024 年 5 月 29 日
14	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京雪球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	2024 年 5 月 31 日
15	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西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	2024 年 5 月 31 日
16	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝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	2024 年 6 月 3 日
17	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增恒泰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	2024 年 6 月 12 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	2024 年 6 月 17 日
19	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西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	2024 年 6 月 27 日
20	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	2024 年 6 月 29 日
21	红土创新基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 29 日
22	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增邮储银行（“邮你同赢”平台）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	2024 年 7 月 10 日
23	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金元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	2024 年 7 月 18 日
24	红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换）业务公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 7 月 18 日
25	红土创新基金管理有限公司关于开展旗下部分基金销售服务费费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 7 月 24 日
26	红土创新基金管理有限公司关于旗下	中国证监会基金电子披	2024 年 7 月 31 日

	部分基金新增普益基金为销售机构的公告	露网站、规定报社及本公司网站	
27	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险代理为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 7 月 31 日
28	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增基煜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	2024 年 8 月 12 日
29	红土创新基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下产品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	2024 年 8 月 16 日
30	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增云湾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	2024 年 8 月 29 日
31	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏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	2024 年 9 月 3 日
32	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇成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	2024 年 9 月 11 日
33	红土创新基金管理有限公司关于终止部分基金销售公司办理旗下产品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	2024 年 9 月 26 日
34	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国联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	2024 年 9 月 30 日
35	红土创新基金管理有限公司关于开展旗下部分基金销售服务费费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 10 月 10 日
36	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰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	2024 年 10 月 30 日
37	红土创新基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金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	2024 年 11 月 1 日
38	红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换）业务公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 11 月 1 日
39	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增辉腾汇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	2024 年 11 月 29 日
40	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大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	2024 年 12 月 6 日

41	红土创新基金管理有限公司关于谨防不法分子假冒“红土创新基金”名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 12 月 7 日
42	红土创新基金管理有限公司关于养老金客户通过直销柜台申购旗下部分开放式基金 A 类基金份额费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 12 月 13 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）红土创新科技创新 3 个月定期开放混合型证券投资基金招募说明书；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

（6）报告期内红土创新科技创新 3 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。

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

红土创新基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日