

# 红塔红土盛利混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：红塔红土基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 22 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、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 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 .....	6
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 其他指标 .....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	12
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
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 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	18
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	57

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	57
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 .....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	62
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 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
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 .....	66
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>66</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	66
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 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</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 .....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>71</b>
13.1 备查文件目录 .....	71
13.2 存放地点 .....	71
13.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红塔红土盛利混合型证券投资基金	
基金简称	红塔红土盛利混合	
基金主代码	012216	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 2 日	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	245,263,705.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C
下属分级基金的交易代码	012216	012217
报告期末下属分级基金的份额总额	236,326,828.66 份	8,936,876.48 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		红塔红土基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王园	韩笑微
	联系电话	0755-33328600	010-68858113
	电子邮箱	htservice@htamc.com.cn	tia donghui@psbc.com
客户服务电话		4001-666-916（免长途话费）	95580
传真		0755-33379015	010-68858120
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	北京市西城区金融大街 3 号

办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道前湾一路 399 号前海嘉里商务中心四期 1 栋 2301	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	518052	100808
法定代表人	龚香林	刘建军

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htamc.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	红塔红土基金管理有限公司	深圳市前海深港合作区南山街道前湾一路 399 号前海嘉里商务中心四期 1 栋 2301

## § 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	2022 年		2021 年 8 月 2 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C
本期已实现收益	-3,460,330.78	-734,528.65	1,821,057.94	594,339.09
本期利润	-20,538,420.52	-5,227,756.40	5,559,799.52	1,402,506.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0868	-0.1746	0.0235	0.0654
本期加权平均净值利润率	-9.16%	-18.39%	2.35%	6.47%
本期基金份额净值增长率	-7.74%	-8.12%	2.29%	2.12%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-13,313,229.30	-551,705.02	1,780,750.69	442,404.64
期末可供分配基金份额利润	-0.0563	-0.0617	0.0073	0.0056
期末基金资产净值	223,013,599.36	8,385,171.46	249,199,656.93	80,046,081.64
期末基金份额净值	0.9437	0.9383	1.0229	1.0212

3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-5.63%	-6.17%	2.29%	2.12%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

红塔红土盛利混合 A

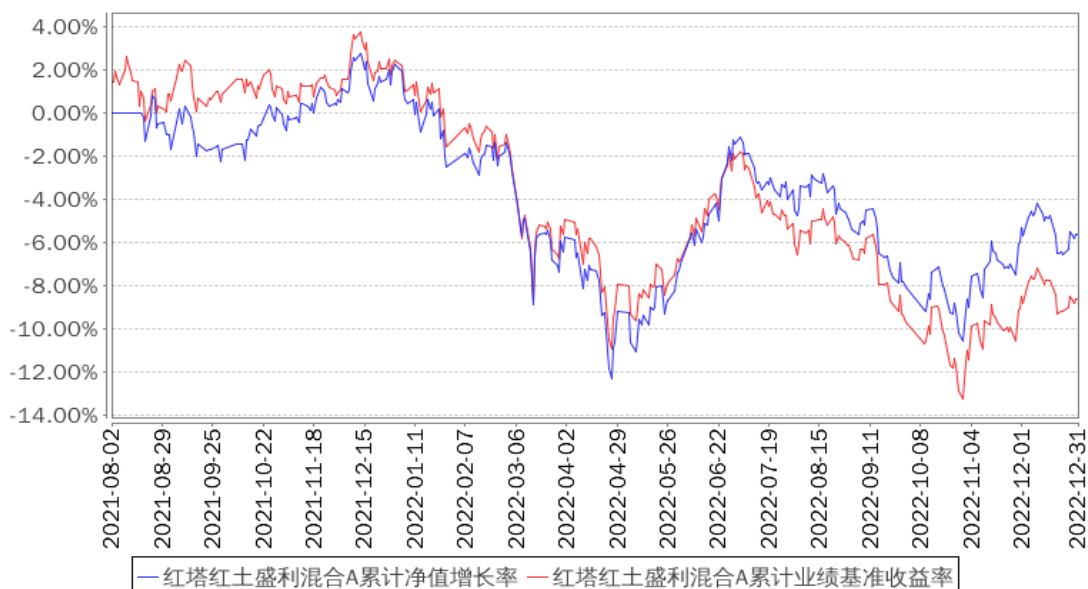
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.61%	0.65%	1.21%	0.70%	1.40%	-0.05%
过去六个月	-4.46%	0.57%	-6.84%	0.60%	2.38%	-0.03%
过去一年	-7.74%	0.71%	-10.78%	0.70%	3.04%	0.01%
自基金合同生效起至今	-5.63%	0.65%	-8.59%	0.65%	2.96%	0.00%

红塔红土盛利混合 C

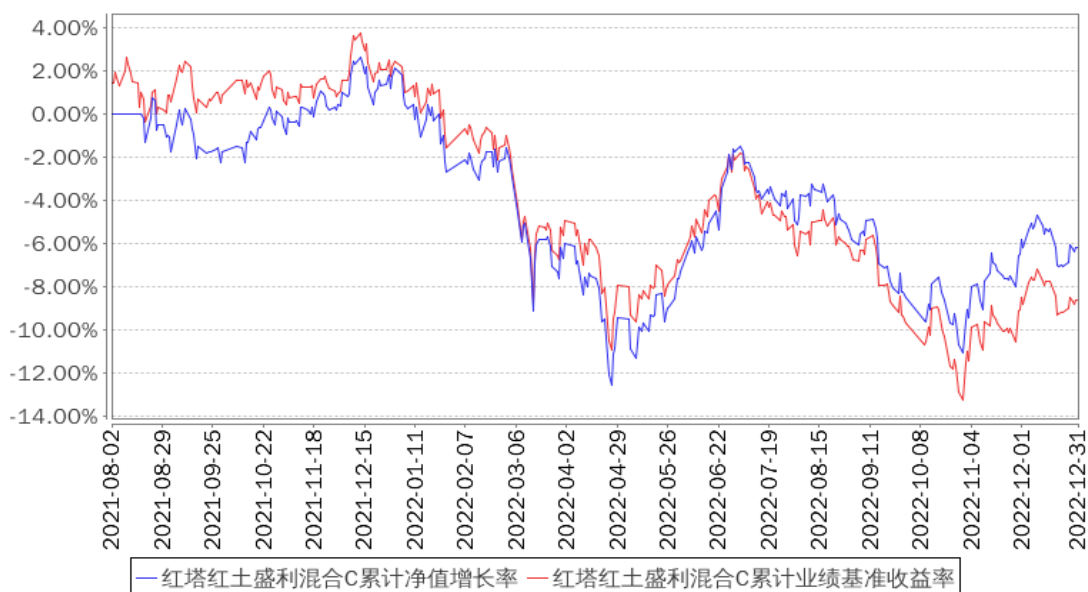
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.51%	0.65%	1.21%	0.70%	1.30%	-0.05%
过去六个月	-4.66%	0.57%	-6.84%	0.60%	2.18%	-0.03%
过去一年	-8.12%	0.71%	-10.78%	0.70%	2.66%	0.01%
自基金合同生效起至今	-6.17%	0.65%	-8.59%	0.65%	2.42%	0.00%

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

红塔红土盛利混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



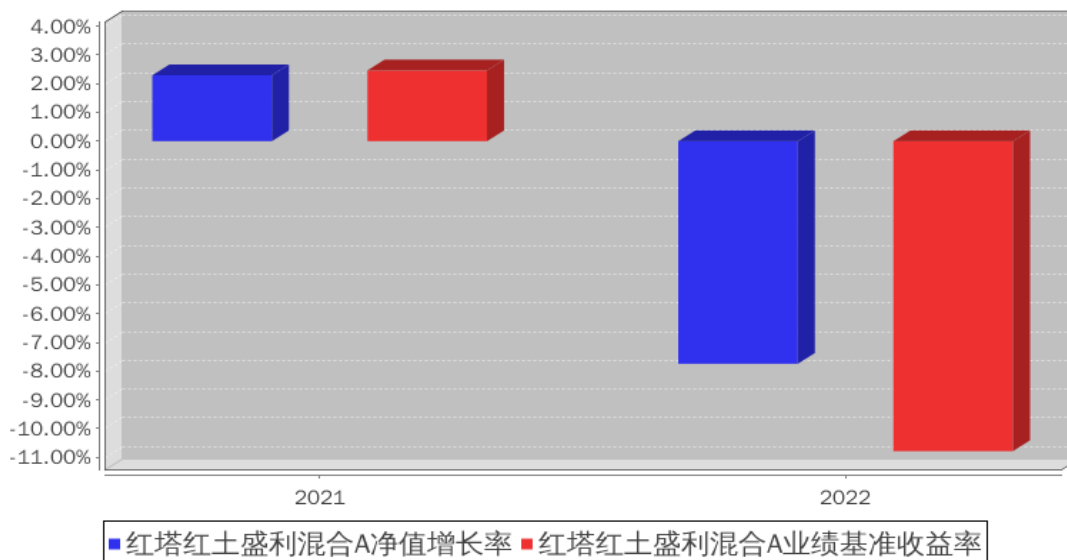
红塔红土盛利混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



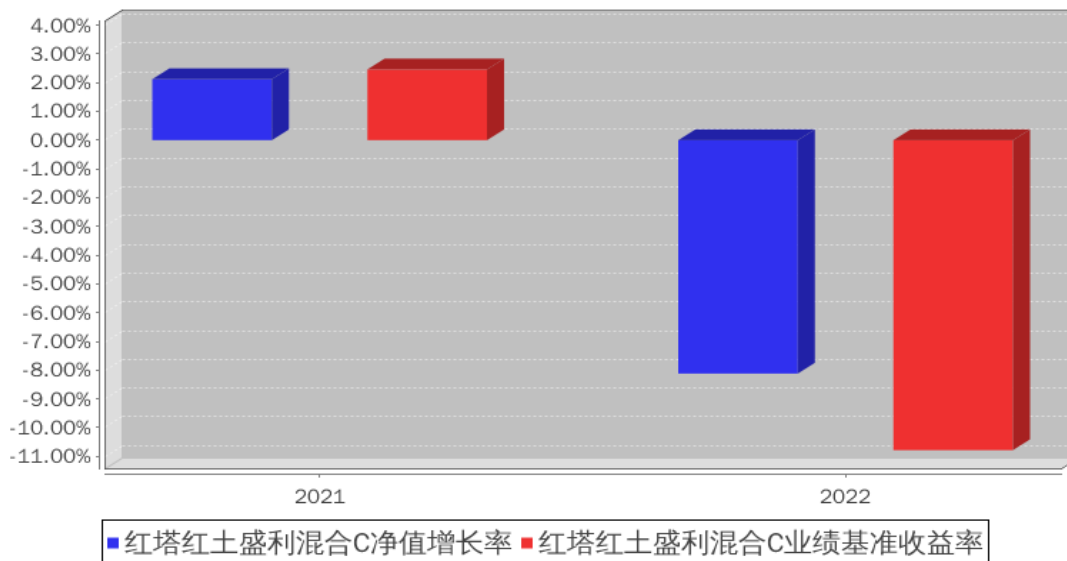


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

红塔红土盛利混合A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



红塔红土盛利混合C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 其他指标

无。

### 3.4 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

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

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

截止至 2022 年 12 月 31 日，公司共有员工 59 人，其中 38 人具有硕士或博士学位；截止 2022 年 12 月 31 日，公司共管理 18 只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴秋松	基金经理	2021 年 8 月 2 日	-	6 年	复旦大学管理学硕士，哈尔滨工业大学工学学士，CFA。曾先后任职于君证资本管理有限公司、银泰证券有限责任公司，2017 年 10 月加入红塔红土基金管理有限公司，现任职红塔红土基金管理有限公司公募投资一部，为公司投资决策委员会委员。

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

2、本基金无基金经理助理。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规，以及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》及其他相关法律法规，制定了《红塔红土基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为确保交易的公平执行，公司交易管理实行集中交易制度，将公司所有投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过集中交易室集中统一完成。该公平交易管理方法规范的范围涵盖一级市场分销、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动；以及研究、授权、决策和执行等投资管理活动的各个环节。

公司建立研究管理平台向所有投资部门人员开放，确保各投资组合公平获得研究资源，通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。在公司备选股票库的基础上，各投资组合应根据不同投资组合的投资目标、投资风格和投资范围，建立不同投资组合的备选股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内独立、自主、审慎决策，超过投资权限的操作需要经过严格的逐级审批程序。基金经理不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，由集中交易室通过投资交易系统内的公平交易模块，按照“价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡”的原则，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对以公司名义开展的场外网下交易，严格按照价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。对于银行间市场交易、交易所大宗交易、非公开发行股票申购、债券一级市场申购等非集中竞价交易，涉及到两个或以上投资组合参与同一证券交易的情况，各投资组合经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。监察稽核部通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则，定期针对旗下所有投资组合在交易所公开竞价交易中的同日同向、临近交易日同向、反向交易记录，

进行交易时机和交易价差的专项统计分析，以排查异常交易。

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年国内经济受疫情冲击、地产周期下行、外需减弱等因素的影响，全年 GDP 增速为 3%，不及 2022 年初的市场预期。2022 年国内固定资产投资同比增长 5.1%，基建投资同比增长 9.4%，制造业同比增长 9.1%，是支撑投资增速的两大主要力量；消费方面，受疫情频发、居民消费意愿不足等影响，2022 年全年社会消费品零售总额同比下降 0.2%；出口方面，2022 年全年呈现前高后低的走势，全年实现同比增长 7%。2022 年全年规模以上工业企业利润总额同比下降 4%，为 1998 年以来年度最低增速。货币流动性方面，央行在 2022 年 1 月 17 日对 7 天逆回购利率和中期借贷便利（MLF）分别降息 10BP，4 月 15 日全面降准 25BP，5 月 20 日实施了非对称降息，1 年期 LPR 不动，5 年期 LPR 下降 15BP；8 月 15 日开展 4000 亿元 MLF 操作和 20 亿元公开市场逆回购操作，MLF 操作利率 2.75%、逆回购操作利率 2.0%，均下调了 10BP；12 月 5 日全面降准 25BP。整体来看，2022 年全年市场资金流动性较为宽松。

2022 年 A 股市场受地缘政治冲突、美联储加息、国内疫情频发、上市公司盈利增速下行等因素的影响，全年上证指数累计下跌 15.13%，上证 50、沪深 300、中证 500、中证 1000 的跌幅在 20%

左右，创业板指、科创 50 的跌幅则达到了 30%左右。行业方面，根据申万一级行业分类，2022 年全年仅有煤炭、综合两个行业取得正收益，其余 29 个行业均呈现不同幅度的下跌，电子、建筑材料、传媒、计算机、电力设备、国防军工等行业跌幅超过了 25%。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红塔红土盛利混合 A 基金份额净值为 0.9437 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.74%；截至本报告期末红塔红土盛利混合 C 基金份额净值为 0.9383 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.12%；同期业绩比较基准收益率为-10.78%。

#### 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 2023 年，国内宏观经济方面，在稳房地产政策持续发力下，房地产投资增速有望扭转下行态势，出口增速可能继续下行，但基建投资、制造业投资仍会是国内经济稳增长的主要抓手，全年预计有望实现较高的增长。2023 年初，国内平稳渡过了本土疫情高峰，疫情对经济的影响将明显降低，同时在 2022 年低基数前提下，2023 年国内消费有望实现较高的增长。整体来看，我们预计 2023 年全年国内 GDP 增速有望实现 5%以上的增长。货币流动性方面，美联储加息已近尾声，国内经济仍处于复苏的前期。随着消费的复苏，2023 年全年国内 CPI 或有所抬升，但我们预计会是温和上升，由此预判全年货币流动性大幅收紧的概率较低。

结合宏观经济与货币流动性的判断，同时 2023 年初 A 股市场各主要指数的估值水平处于历史低位水平，所以我们预计 2023 年全年 A 股市场会有不错的投资机会。另一方面，我们会更多关注结构性的机会，尤其是新基建与新能源等相关行业的机会。我们认为新基建、新能源是未来我国实现产业升级的重要发展方向，这其中将会有足够大的市场规模与足够快的发展速度，也即意味着有更多具备投资价值的上市公司，值得我们去挖掘与投资持有。同时，2022 年 TMT 信息产业整体跌幅靠前，估值处于历史底部区域，2023 年该行业部分公司有望实现较高的业绩增长，有望走出估值底部，存在“戴维斯双击”的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人内部开展的有关本基金的监察稽核工作包括，严格事前的监督审查，通过系统和人工相结合，开展事中监控、事后检查稽核，保障业务运作的合法合规性。监察稽核部对基金募集和持续营销、基金等各受托资产的投资管理、基金信息披露等方面进行事先合规审核，通过投资交易系统预设风控指标阈值对相关投资组合的合规风险实现事前控制，通过公平交易模块对本基金及基金管理人管理的其他投资组合之间的公平交易情况进行每日监控和定期分析，

对各投资组合的潜在异常交易进行每日监测和分析；定期、不定期地对本基金投资、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行全面检查，对控制手段提出改进建议和督促业务部门改进存在问题。此外，监察稽核部还根据新出台的法律法规和行业的新要求，督促公司各部门及时制定、更新规章制度和业务流程，有计划、有针对性地对全体员工、投资管理人员及其他相关业务人员进行多种形式的法律合规培训，每当新法规出台时，及时向公司员工发送并对有关新法规的主要条款进行解释或培训，促进公司合规文化的建设。

#### 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、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

## 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

本托管人依法对红塔红土基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 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(2023)第 20637 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	红塔红土盛利混合型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>我们审计了红塔红土盛利混合型证券投资基金(以下简称“红塔红土盛利混合基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)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则和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,公允反映了红塔红土盛利混合基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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,我们独立于红塔红土盛利混合基金,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	-
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>红塔红土盛利混合基金的基金管理人红塔红土基金管理有限公司(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塔红土盛利混合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塔红土盛利混合基金、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塔红土盛利混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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,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,就可能对红塔红土盛利混合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塔红土盛利混合基金不能持续经营。</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>



	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。	
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	吴琳杰
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼	
审计报告日期	2023 年 3 月 16 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：红塔红土盛利混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,295,801.35	6,763,584.84
结算备付金		724,841.51	255,486.34
存出保证金		29,846.07	93,332.69
交易性金融资产	7.4.7.2	212,552,943.33	378,891,871.41
其中：股票投资		117,421,019.01	171,509,061.41
基金投资		-	-
债券投资		95,131,924.32	207,382,810.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	14,995,521.42	17,200,133.80
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		155,983.08	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	3,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	2,917,292.17
资产总计		231,754,936.76	406,124,701.25
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 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		-	75,399,686.90
应付清算款		-	1,003,214.41
应付赎回款		60.39	50.87
应付管理人报酬		118,236.03	161,377.28
应付托管费		29,558.99	40,344.32
应付销售服务费		2,856.20	23,585.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,471.31	9,101.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	201,983.02	241,601.92
负债合计		356,165.94	76,878,962.68
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	245,263,705.14	322,010,189.83
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-13,864,934.32	7,235,548.74
净资产合计		231,398,770.82	329,245,738.57
负债和净资产总计		231,754,936.76	406,124,701.25

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 245,263,705.14 份，其中 A 类基金份额净值 0.9437 元，基金份额 236,326,828.66 份；C 类基金份额净值 0.9383 元，基金份额 8,936,876.48 份。

## 7.2 利润表

会计主体：红塔红土盛利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 2 日（基金 合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-22,451,423.46	8,822,077.13
1. 利息收入		164,158.58	1,499,743.23
其中：存款利息收入	7.4.7.13	72,224.80	105,938.26
债券利息收入		-	1,304,805.61
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		91,933.78	88,999.36

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,045,137.86	2,775,203.45
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-7,327,527.88	2,576,550.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	3,702,406.93	-6,359.18
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
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	2,579,983.09	205,012.20
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-21,571,317.49	4,546,908.85
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	873.31	221.60
<b>减：二、营业总支出</b>		3,314,753.46	1,859,771.25
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,522,107.77	640,035.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	380,526.93	160,008.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	117,177.64	33,970.57
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,067,910.37	450,175.70
其中：卖出回购金融资产支出		1,067,910.37	450,175.70
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		10,430.75	3,421.25
8. 其他费用	7.4.7.23	216,600.00	572,159.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-25,766,176.92	6,962,305.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-25,766,176.92	6,962,305.88
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-25,766,176.92	6,962,305.88

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：红塔红土盛利混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	322,010,189.83	-	7,235,548.74	329,245,738.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	322,010,189.83	-	7,235,548.74	329,245,738.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-76,746,484.69	-	-21,100,483.06	-97,846,967.75
（一）、综合收益总额	-	-	-25,766,176.92	-25,766,176.92
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-76,746,484.69	-	4,665,693.86	-72,080,790.83
其中：1. 基金申购款	43,676,616.98	-	-1,559,516.68	42,117,100.30
2. 基金赎回款	-120,423,101.67	-	6,225,210.54	-114,197,891.13

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	245,263,705.14	-	-13,864,934.32	231,398,770.82
项目	上年度可比期间			
	2021年8月2日(基金合同生效日)至2021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(基金净值)	-	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	220,285,337.44	-	-	220,285,337.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	101,724,852.39	-	7,235,548.74	108,960,401.13
(一)、综合收益总额	-	-	6,962,305.88	6,962,305.88
(二)、本期基金份额	101,724,852.39	-	273,242.86	101,998,095.25

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	101,876,740.22	-	274,299.34	102,151,039.56
2. 基金赎回款	-151,887.83	-	-1,056.48	-152,944.31
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	322,010,189.83	-	7,235,548.74	329,245,738.57

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：

杨洁

杨洁

李志朋

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

红塔红土盛利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[2021]1303 号文《关于准予红塔红土盛利混合型证券投资基金注册的

批复》核准，由红塔红土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《红塔红土盛利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 220,284,451.00 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2021)验字第 61014670\_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《红塔红土盛利混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 220,285,337.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 886.40 份基金份额。本基金的基金管理人为红塔红土基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《红塔红土盛利混合型证券投资基金基金合同》，在投资者认/申购时收取认/申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 A 类基金份额；在投资者认/申购时不收取认/申购费，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。计算公式为：计算日某类基金份额净值=该计算日该类基金份额的基金资产净值/该计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红塔红土盛利混合型证券投资基金基金合同》，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 50%-95%；每隔交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+中债总指数(财富)收益率×45%。

本财务报表由本基金的基金管理人红塔红土基金管理有限公司于 2023 年 3 月 16 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》、《红塔红土盛利混合型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 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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。比较财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

#### 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

##### 新金融工具准则

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

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

##### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。



以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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

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

#### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

##### 新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者

(3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

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

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

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益; 对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

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

#### 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。

#### 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

##### 新金融工具准则

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

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

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

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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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

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。

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

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。

#### 7.4.4.13 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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证

券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为 6,763,584.84 元、255,486.34 元、93,332.69 元、17,200,133.80 元、2,917,292.17 元和 3,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 6,766,389.82 元、255,612.84 元、93,378.89 元、17,202,139.95 元、0.00 元和 3,000.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 378,891,871.41 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 381,804,179.75 元。

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

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类

别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

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

#### 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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	3,295,801.35	6,763,584.84
等于：本金	3,295,097.29	6,763,584.84
加：应计利息	704.06	-
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	3,295,801.35	6,763,584.84

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	134,371,477.33	-	117,421,019.01	-16,950,458.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	13,853,190.80	246,769.48	14,070,187.48	-29,772.80
	银行间市场	79,831,177.52	1,274,736.84	81,061,736.84	-44,177.52
	合计	93,684,368.32	1,521,506.32	95,131,924.32	-73,950.32
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		228,055,845.65	1,521,506.32	212,552,943.33	-17,024,408.64
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		167,059,644.90	-	171,509,061.41	4,449,416.51
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	18,101,830.00	-	18,101,810.00	-20.00
	银行间市场	189,183,487.66	-	189,281,000.00	97,512.34
	合计	207,285,317.66	-	207,382,810.00	97,492.34
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		374,344,962.56	-	378,891,871.41	4,546,908.85

#### 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。

#### 7.4.7.4 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,995,521.42	-
银行间市场	-	-
合计	14,995,521.42	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,000,000.00	-
银行间市场	9,200,133.80	-
合计	17,200,133.80	-

##### 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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	2,917,292.17
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	2,917,292.17

## 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021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	22,983.02	144,323.84
其中：交易所市场	22,213.02	139,548.99
银行间市场	770.00	4,774.85
应付利息	-	47,278.08
预提信息披露费	120,000.00	-
预提审计费	50,000.00	50,000.00
预提银行间账户维护费	9,000.00	-
合计	201,983.02	241,601.92

## 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

## 红塔红土盛利混合 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	243,625,252.80	243,625,252.80
本期申购	15,838,251.77	15,838,251.77
本期赎回（以“-”号填列）	-23,136,675.91	-23,136,675.91

基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	236,326,828.66	236,326,828.66

红塔红土盛利混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	78,384,937.03	78,384,937.03
本期申购	27,838,365.21	27,838,365.21
本期赎回（以“-”号填列）	-97,286,425.76	-97,286,425.76
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	8,936,876.48	8,936,876.48

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

红塔红土盛利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,780,750.69	3,793,653.44	5,574,404.13
本期利润	-3,460,330.78	-17,078,089.74	-20,538,420.52
本期基金份额交易产生的变动数	-111,732.44	1,762,519.53	1,650,787.09
其中：基金申购款	-143,468.25	-338,858.36	-482,326.61
基金赎回款	31,735.81	2,101,377.89	2,133,113.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,791,312.53	-11,521,916.77	-13,313,229.30

红塔红土盛利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	442,404.64	1,218,739.97	1,661,144.61
本期利润	-734,528.65	-4,493,227.75	-5,227,756.40
本期基金份额交易产生的变动数	175,460.51	2,839,446.26	3,014,906.77
其中：基金申购款	170,258.37	-1,247,448.44	-1,077,190.07
基金赎回款	5,202.14	4,086,894.70	4,092,096.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-116,663.50	-435,041.52	-551,705.02

## 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月2日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	64,539.76	94,703.42
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	6,766.49	10,797.80
其他	918.55	437.04
合计	72,224.80	105,938.26

## 7.4.7.11 股票投资收益

## 7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月2日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	171,998,807.95	123,167,004.73
减：卖出股票成本总额	178,840,385.87	120,590,454.30
减：交易费用	485,949.96	-
买卖股票差价收入	-7,327,527.88	2,576,550.43

## 7.4.7.12 债券投资收益

## 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月2日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	3,941,906.26	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-239,499.33	-6,359.18
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	3,702,406.93	-6,359.18

## 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年8月2日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	375,951,175.53	30,154,865.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	369,477,488.89	29,786,589.45
减：应计利息总额	6,708,067.67	374,635.14
减：交易费用	5,118.30	-
买卖债券差价收入	-239,499.33	-6,359.18

## 7.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

## 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

## 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年8月2日（基金合同生 效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利 收益	2,579,983.09	205,012.20
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	2,579,983.09	205,012.20

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年8月2日（基金 合同生效日）至2021年12月 31日
1. 交易性金融资产	-21,571,317.49	4,546,908.85
股票投资	-21,399,874.83	4,449,416.51
债券投资	-171,442.66	97,492.34
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	-21,571,317.49	4,546,908.85

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年8月2日（基金 合同生效日）至2021年12月

		31 日
基金赎回费收入	873.31	221.60
合计	873.31	221.60

#### 7.4.7.19 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 8 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	45,000.00	3,000.00
其他	1,600.00	100.00
交易费用	-	519,059.46
合计	216,600.00	572,159.46

#### 7.4.7.21 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

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
红塔红土基金管理有限公司（“红塔红土基金公司”）	基金管理人、注册登记机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人
红塔证券股份有限公司（“红塔证券”）	基金管理人的股东
深圳市创新投资集团有限公司	基金管理人的股东
北京市华远集团有限公司	基金管理人的股东
深圳市红塔资产管理有限公司（“红塔资产”）	基金管理人的子公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日		上年度可比期间 2021年8月2日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
红塔证券	165,859,401.59	55.52	213,208,642.26	52.80

## 7.4.10.1.2 债券交易

无。

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日		上年度可比期间 2021年8月2日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）
红塔证券	-	-	818,400,000.00	80.05

## 7.4.10.1.4 权证交易

无。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
红塔证券	154,465.53	61.38	16,763.21	75.47
关联方名称	上年度可比期间 2021年8月2日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
红塔证券	198,561.97	58.75	80,759.27	57.87

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息

服务等。

#### 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 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年8月2日（基金合 同生效日）至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,522,107.77	640,035.38
其中：支付销售机构的客户维护 费	437,163.47	184,172.62

注：支付基金管理人红塔红土基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年8月2日（基金合 同生效日）至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	380,526.93	160,008.89

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

##### 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 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C	合计
红塔红土基金公司	-	13,350.31	13,350.31
红塔证券	-	28,953.96	28,953.96
合计	-	42,304.27	42,304.27
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2021年8月2日（基金合同生效日）至2021年12月31日		

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C	合计
红塔红土基金公司	-	821.29	821.29
红塔证券	-	1,192.35	1,192.35
合计	-	2,013.64	2,013.64

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，按月支付给红塔红土基金公司，再由红塔红土基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

#### 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

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 8 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 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
中国邮政储蓄银行	3,295,801.35	64,539.76	6,763,584.84	94,703.42

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，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（2022 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	新股锁定	237.50	176.97	121	28,737.50	21,413.37	-
301308	江波龙	2022 年 7 月 27 日	6 个月	新股锁定	55.67	56.72	321	17,870.07	18,207.12	-
301330	熵基科技	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定	43.32	31.31	366	15,855.12	11,459.46	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	38.46	25.31	379	14,576.34	9,592.49	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	3.82	6.01	3,663	13,992.66	22,014.63	-
301152	天力锂电	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定	57.00	46.64	241	13,737.00	11,240.24	-
301195	北路智控	2022 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定	71.17	73.04	180	12,810.60	13,147.20	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股锁定	33.65	69.68	360	12,114.00	25,084.80	-
301356	天振股份	2022 年 11 月 3 日	6 个月	新股锁定	63.00	43.33	191	12,033.00	8,276.03	-

301326	捷邦科技	2022年 9月9日	6个月	新股锁定	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301338	凯格精机	2022年 8月8日	6个月	新股锁定	46.33	48.99	253	11,721.49	12,394.47	-
301223	中荣股份	2022年 10月13日	6个月	新股锁定	26.28	18.13	443	11,642.04	8,031.59	-
301335	天元宠物	2022年 11月11日	6个月	新股锁定	49.98	33.82	218	10,895.64	7,372.76	-
301227	森鹰窗业	2022年 9月16日	6个月	新股锁定	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301366	一博科技	2022年 9月19日	6个月	新股锁定	65.35	45.09	163	10,652.05	7,349.67	-
301396	宏景科技	2022年 11月4日	6个月	新股锁定	40.13	31.90	264	10,594.32	8,421.60	-
301365	矩阵股份	2022年 11月14日	6个月	新股锁定	34.72	23.87	305	10,589.60	7,280.35	-
301273	瑞晨环保	2022年 10月11日	6个月	新股锁定	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301276	嘉曼服饰	2022年 9月1日	6个月	新股锁定	40.66	22.61	246	10,002.36	5,562.06	-
301391	卡莱特	2022年 11月24日	6个月	新股锁定	96.00	80.97	104	9,984.00	8,420.88	-
301176	逸豪新材	2022年 9月21日	6个月	新股锁定	23.88	16.89	418	9,981.84	7,060.02	-
301377	鼎泰高科	2022年 11月11日	6个月	新股锁定	22.88	17.63	433	9,907.04	7,633.79	-
301230	泓博医药	2022年 10月21日	6个月	新股锁定	40.00	48.32	247	9,880.00	11,935.04	-
301290	东星医疗	2022年 11月	6个月	新股锁定	44.09	35.13	220	9,699.80	7,728.60	-

		23 日									
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁 定	5.00	7.53	1,921	9,605.00	14,465.13		-
301306	西测测 试	2022 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁 定	43.23	42.29	218	9,424.14	9,219.22		-
301363	美好医 疗	2022 年 9 月 28 日	6 个月	新股锁 定	30.66	37.85	304	9,320.64	11,506.40		-
301283	聚胶股 份	2022 年 8 月 26 日	6 个月	新股锁 定	52.69	51.41	175	9,220.75	8,996.75		-
301318	维海德	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁 定	64.68	41.74	141	9,119.88	5,885.34		-
301165	锐捷网 络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁 定	32.38	31.61	276	8,936.88	8,724.36		-
301398	星源卓 镁	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股锁 定	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70		-
301297	富乐德	2022 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁 定	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85		-
301285	鸿日达	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股锁 定	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00		-
301171	易点天 下	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁 定	18.18	17.72	443	8,053.74	7,849.96		-
301349	信德新 材	2022 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁 定	138.88	103.52	56	7,777.28	5,797.12		-
301300	远翔新 材	2022 年 8 月 9 日	6 个月	新股锁 定	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07		-
301277	新天地	2022 年 11 月 9 日	6 个月	新股锁 定	27.00	25.78	279	7,533.00	7,192.62		-
301368	丰立智 能	2022 年 12 月 7 日	6 个月	新股锁 定	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24		-
301231	荣信文	2022 年	6 个月	新股锁	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50		-

	化	8月31日		定							
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股锁定	39.00	24.46	170	6,630.00	4,158.20		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40		-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股锁定	13.28	11.40	491	6,520.48	5,597.40		-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股锁定	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股锁定	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股锁定	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股锁定	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-

注：1、基金作为特定投资者认购的由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。

2、基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为特定投资者认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让；发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期；基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

3、基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

4、基金通过询价转让受让的科创板上市公司股东首次公开发行前已发行股份，在受让后6个月内不得转让。

5、本基金在持有上述受限证券期间，若获得送股配股等权益，其数量与金额也包含在上述披露的相应受限证券数据中。

#### 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，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。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在严格控制投资组合风险的前提下，寻找有持续增长潜力且相对被市场低估的个券，优化投资组合，力求实现持续稳健的资产增值。

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

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

#### 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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	20,126,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	40,388,605.55	90,164,000.00
合计	40,388,605.55	110,290,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

3. 债券投资以全价列示。

#### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	19,924,788.35	48,691,000.00
合计	19,924,788.35	48,691,000.00

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
--------	-------------------------	--------------------------

AAA	30,766,801.10	30,300,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	4,051,729.32	18,101,810.00
合计	34,818,530.42	48,401,810.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

3. 债券投资以全价列示。

#### 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 2022 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款将在 1 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。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 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,295,801.35	-	-	-	3,295,801.35
结算备付金	724,841.51	-	-	-	724,841.51
存出保证金	29,846.07	-	-	-	29,846.07
交易性金融资产	95,131,924.32	-	-	117,421,019.01	212,552,943.33
买入返售金融资产	14,995,521.42	-	-	-	14,995,521.42
应收清算款	-	-	-	155,983.08	155,983.08
资产总计	114,177,934.67	-	-	117,577,002.09	231,754,936.76
负债					

应付赎回款	-	-	-	60.39	60.39
应付管理人报酬	-	-	-	118,236.03	118,236.03
应付托管费	-	-	-	29,558.99	29,558.99
应付销售服务费	-	-	-	2,856.20	2,856.20
应交税费	-	-	-	3,471.31	3,471.31
其他负债	-	-	-	201,983.02	201,983.02
负债总计	-	-	-	356,165.94	356,165.94
利率敏感度缺口	114,177,934.67	-	-	-117,220,836.15	231,398,770.82
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,763,584.84	-	-	-	6,763,584.84
结算备付金	255,486.34	-	-	-	255,486.34
存出保证金	93,332.69	-	-	-	93,332.69
交易性金融资产	207,382,810.00	-	-	-171,509,061.41	378,891,871.41
买入返售金融资产	17,200,133.80	-	-	-	17,200,133.80
应收申购款	-	-	-	3,000.00	3,000.00
其他资产	-	-	-	2,917,292.17	2,917,292.17
资产总计	231,695,347.67	-	-	-174,429,353.58	406,124,701.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	50.87	50.87
应付管理人报酬	-	-	-	161,377.28	161,377.28
应付托管费	-	-	-	40,344.32	40,344.32
应付证券清算款	-	-	-	1,003,214.41	1,003,214.41
卖出回购金融资产款	75,399,686.90	-	-	-	75,399,686.90
应付销售服务费	-	-	-	23,585.11	23,585.11
应交税费	-	-	-	9,101.87	9,101.87
其他负债	-	-	-	241,601.92	241,601.92
负债总计	75,399,686.90	-	-	1,479,275.78	76,878,962.68
利率敏感度缺口	156,295,660.77	-	-	-172,950,077.80	329,245,738.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	

分析	1、市场利率上升 25 个基准点	-43,833.80	-157,558.72
	2、市场利率下降 25 个基准点	43,887.71	157,889.44

#### 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 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	117,421,019.01	50.74	171,509,061.41	52.09
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	207,382,810.00	62.99
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	117,421,019.01	50.74	378,891,871.41	115.08

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	11,386,229.00	13,573,039.39
	2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-11,386,229.00	-13,573,039.39

## 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	116,989,276.64	170,890,991.00
第二层次	95,131,924.32	208,000,880.41
第三层次	431,742.37	-
合计	212,552,943.33	378,891,871.41

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 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

项目	本期 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,753,334.04	2,753,334.04
转出第三层次	-	2,933,813.13	2,933,813.13
当期利得或损失总额	-	612,221.46	612,221.46
其中：计入损益的利得或损失	-	612,221.46	612,221.46
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	431,742.37	431,742.37
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	-	-34,975.03	-34,975.03
项目	上年度可比同期 2021年8月2日（基金合同生效日）至2021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	-	-	-
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	-	-	-

注：于 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 2022 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。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 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
交易性金融资产-股票投资	431,742.37	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关
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
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 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	117,421,019.01	50.67
	其中：股票	117,421,019.01	50.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	95,131,924.32	41.05
	其中：债券	95,131,924.32	41.05
	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	14,995,521.42	6.47
	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	4,020,642.86	1.73
8	其他各项资产	185,829.15	0.08
9	合计	231,754,936.76	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	975,000.00	0.42
B	采矿业	4,859,340.00	2.10
C	制造业	62,478,068.21	27.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,917,300.00	0.83
E	建筑业	1,031,700.00	0.45
F	批发和零售业	468,000.00	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	1,143,344.00	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,596,969.41	1.99
J	金融业	30,407,865.00	13.14
K	房地产业	2,545,800.00	1.10
L	租赁和商务服务业	1,627,709.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	2,392,219.46	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	22,014.63	0.01

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,578,584.80	0.68
R	文化、体育和娱乐业	1,377,104.50	0.60
S	综合	-	-
	合计	117,421,019.01	50.74

### 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	000001	平安银行	360,000	4,737,600.00	2.05
2	601318	中国平安	79,100	3,717,700.00	1.61
3	600036	招商银行	98,500	3,670,110.00	1.59
4	600519	贵州茅台	2,000	3,454,000.00	1.49
5	002966	苏州银行	440,000	3,423,200.00	1.48
6	600919	江苏银行	389,000	2,835,810.00	1.23
7	000063	中兴通讯	106,400	2,751,504.00	1.19
8	000858	五粮液	14,200	2,565,798.00	1.11
9	300799	左江科技	18,000	2,346,480.00	1.01
10	002384	东山精密	90,000	2,225,700.00	0.96
11	601818	光大银行	700,000	2,149,000.00	0.93
12	002142	宁波银行	63,300	2,054,085.00	0.89
13	300014	亿纬锂能	22,000	1,933,800.00	0.84
14	600900	长江电力	91,300	1,917,300.00	0.83
15	002475	立讯精密	60,000	1,905,000.00	0.82
16	000333	美的集团	36,300	1,880,340.00	0.81
17	002371	北方华创	8,000	1,802,400.00	0.78
18	300760	迈瑞医疗	5,700	1,801,029.00	0.78
19	000725	京东方 A	525,600	1,776,528.00	0.77
20	300083	创世纪	200,331	1,696,803.57	0.73
21	002594	比亚迪	6,400	1,644,608.00	0.71
22	000002	万科 A	90,000	1,638,000.00	0.71
23	300015	爱尔眼科	50,000	1,553,500.00	0.67
24	002129	TCL 中环	40,800	1,536,528.00	0.66
25	601857	中国石油	302,000	1,500,940.00	0.65
26	300408	三环集团	48,800	1,498,648.00	0.65
27	000783	长江证券	266,000	1,417,780.00	0.61
28	600030	中信证券	70,000	1,393,700.00	0.60
29	300347	泰格医药	13,000	1,362,400.00	0.59

30	000568	泸州老窖	6,000	1,345,680.00	0.58
31	603288	海天味业	16,800	1,337,280.00	0.58
32	300705	九典制药	50,000	1,215,000.00	0.53
33	600887	伊利股份	38,800	1,202,800.00	0.52
34	600019	宝钢股份	212,800	1,189,552.00	0.51
35	601888	中国中免	5,500	1,188,165.00	0.51
36	300059	东方财富	61,200	1,187,280.00	0.51
37	300750	宁德时代	3,000	1,180,260.00	0.51
38	002179	中航光电	20,020	1,156,355.20	0.50
39	002415	海康威视	33,200	1,151,376.00	0.50
40	601225	陕西煤业	60,000	1,114,800.00	0.48
41	600309	万华化学	11,900	1,102,535.00	0.48
42	600600	青岛啤酒	10,000	1,075,000.00	0.46
43	601166	兴业银行	60,000	1,055,400.00	0.46
44	600926	杭州银行	80,000	1,046,400.00	0.45
45	601668	中国建筑	190,000	1,031,700.00	0.45
46	601615	明阳智能	40,000	1,010,400.00	0.44
47	603259	药明康德	12,200	988,200.00	0.43
48	002714	牧原股份	20,000	975,000.00	0.42
49	601012	隆基绿能	22,800	963,528.00	0.42
50	300316	晶盛机电	15,000	953,400.00	0.41
51	600196	复星医药	26,800	944,432.00	0.41
52	000999	华润三九	20,000	936,200.00	0.40
53	688568	中科星图	15,000	930,600.00	0.40
54	002049	紫光国微	7,000	922,740.00	0.40
55	002739	万达电影	65,800	921,200.00	0.40
56	600048	保利发展	60,000	907,800.00	0.39
57	603668	天马科技	50,000	896,000.00	0.39
58	601688	华泰证券	70,000	891,800.00	0.39
59	002385	大北农	100,000	890,000.00	0.38
60	600348	华阳股份	60,000	855,000.00	0.37
61	600893	航发动力	20,000	845,600.00	0.37
62	002939	长城证券	100,000	828,000.00	0.36
63	002011	盾安环境	60,000	787,800.00	0.34
64	300122	智飞生物	8,600	755,338.00	0.33
65	002402	和而泰	50,000	729,000.00	0.32
66	601877	正泰电器	26,300	728,510.00	0.31
67	600256	广汇能源	80,000	721,600.00	0.31
68	002463	沪电股份	60,000	714,000.00	0.31
69	601899	紫金矿业	66,700	667,000.00	0.29
70	603806	福斯特	10,000	664,400.00	0.29
71	300124	汇川技术	9,400	653,300.00	0.28
72	000977	浪潮信息	30,000	645,600.00	0.28

73	002304	洋河股份	4,000	642,000.00	0.28
74	002230	科大讯飞	19,400	636,902.00	0.28
75	603444	吉比特	2,000	625,680.00	0.27
76	300035	中科电气	30,000	617,400.00	0.27
77	600004	白云机场	40,000	600,400.00	0.26
78	600585	海螺水泥	21,800	596,884.00	0.26
79	300073	当升科技	10,000	564,000.00	0.24
80	002466	天齐锂业	7,000	552,930.00	0.24
81	601238	广汽集团	50,000	551,500.00	0.24
82	002812	恩捷股份	4,200	551,418.00	0.24
83	002352	顺丰控股	9,400	542,944.00	0.23
84	002008	大族激光	20,000	513,000.00	0.22
85	600031	三一重工	30,000	474,000.00	0.20
86	000963	华东医药	10,000	468,000.00	0.20
87	300413	芒果超媒	15,000	450,300.00	0.19
88	603076	乐惠国际	12,000	441,600.00	0.19
89	002027	分众传媒	65,800	439,544.00	0.19
90	688072	拓荆科技	2,000	433,500.00	0.19
91	300568	星源材质	20,000	425,200.00	0.18
92	600176	中国巨石	30,000	411,300.00	0.18
93	600276	恒瑞医药	10,000	385,300.00	0.17
94	300223	北京君正	3,000	211,320.00	0.09
95	600111	北方稀土	8,400	210,420.00	0.09
96	301326	捷邦科技	2,264	87,002.05	0.04
97	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.03
98	301239	普瑞眼科	360	25,084.80	0.01
99	301175	中科环保	3,663	22,014.63	0.01
100	301327	华宝新能	121	21,413.37	0.01
101	301308	江波龙	321	18,207.12	0.01
102	301301	川宁生物	1,921	14,465.13	0.01
103	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.01
104	301195	北路智控	180	13,147.20	0.01
105	301338	凯格精机	253	12,394.47	0.01
106	301230	泓博医药	247	11,935.04	0.01
107	301363	美好医疗	304	11,506.40	0.00
108	301330	瀚基科技	366	11,459.46	0.00
109	301152	天力锂能	241	11,240.24	0.00
110	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
111	301139	元道通信	379	9,592.49	0.00
112	301306	西测测试	218	9,219.22	0.00
113	301283	聚胶股份	175	8,996.75	0.00
114	301165	锐捷网络	276	8,724.36	0.00
115	301396	宏景科技	264	8,421.60	0.00

116	301391	卡莱特	104	8,420.88	0.00
117	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
118	301356	天振股份	191	8,276.03	0.00
119	301223	中荣股份	443	8,031.59	0.00
120	301171	易点天下	443	7,849.96	0.00
121	301290	东星医疗	220	7,728.60	0.00
122	301377	鼎泰高科	433	7,633.79	0.00
123	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
124	301335	天元宠物	218	7,372.76	0.00
125	301366	一博科技	163	7,349.67	0.00
126	301365	矩阵股份	305	7,280.35	0.00
127	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
128	301277	新天地	279	7,192.62	0.00
129	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
130	301176	逸豪新材	418	7,060.02	0.00
131	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
132	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
133	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
134	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
135	301318	维海德	141	5,885.34	0.00
136	301349	信德新材	56	5,797.12	0.00
137	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
138	301265	华新环保	491	5,597.40	0.00
139	301276	嘉曼服饰	246	5,562.06	0.00
140	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
141	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
142	301309	万得凯	170	4,158.20	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	300750	宁德时代	5,526,054.50	1.68
2	300014	亿纬锂能	4,740,568.00	1.44
3	000001	平安银行	4,623,300.00	1.40
4	601818	光大银行	4,373,000.00	1.33
5	002966	苏州银行	3,551,200.00	1.08
6	601857	中国石油	2,788,400.00	0.85
7	000651	格力电器	2,606,677.00	0.79
8	601949	中国出版	2,517,643.00	0.76
9	002384	东山精密	2,410,930.00	0.73
10	300705	九典制药	2,305,295.40	0.70
11	601225	陕西煤业	2,270,642.00	0.69

12	601166	兴业银行	2,154,513.00	0.65
13	002385	大北农	2,078,800.00	0.63
14	002371	北方华创	2,008,485.00	0.61
15	300413	芒果超媒	1,680,190.00	0.51
16	000002	万科 A	1,645,190.00	0.50
17	601615	明阳智能	1,584,482.00	0.48
18	300015	爱尔眼科	1,496,175.00	0.45
19	603288	海天味业	1,483,694.80	0.45
20	600383	金地集团	1,448,153.00	0.44

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

#### 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	601818	光大银行	5,172,000.00	1.57
2	601800	中国交建	4,000,703.00	1.22
3	600383	金地集团	3,395,625.00	1.03
4	601166	兴业银行	3,374,901.00	1.03
5	300750	宁德时代	3,359,600.00	1.02
6	002011	盾安环境	3,354,625.00	1.02
7	600519	贵州茅台	3,260,546.36	0.99
8	300014	亿纬锂能	3,170,863.00	0.96
9	000001	平安银行	2,529,717.00	0.77
10	000066	中国长城	2,476,412.00	0.75
11	300799	左江科技	2,438,090.00	0.74
12	000963	华东医药	2,418,841.00	0.73
13	601615	明阳智能	2,315,041.00	0.70
14	000651	格力电器	2,278,472.00	0.69
15	002236	大华股份	2,272,480.83	0.69
16	600460	士兰微	2,204,548.00	0.67
17	601949	中国出版	2,158,743.00	0.66
18	002384	东山精密	1,997,926.00	0.61
19	002271	东方雨虹	1,975,970.00	0.60
20	601088	中国神华	1,845,952.00	0.56

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	146,152,218.30
卖出股票收入（成交）总额	171,998,807.95

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	14,070,187.48	6.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,370,147.39	13.12
6	中期票据	30,766,801.10	13.30
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	19,924,788.35	8.61
9	其他	-	-
10	合计	95,131,924.32	41.11

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	101800499	18 华能集 MTN001	100,000	10,390,664.66	4.49
2	102000363	20 汇金 MTN003	100,000	10,227,205.48	4.42
3	042280089	22 国电 CP001	100,000	10,177,871.78	4.40
4	102000838	20 中铁股 MTN002	100,000	10,148,930.96	4.39
5	012281901	22 南航股 SCP012	100,000	10,113,876.71	4.37

### 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

平安银行（代码：000001）发行主体平安银行股份有限公司的如下违法违规事实于 2022 年 3 月 21 日受到中国银行保险监督管理委员会罚款合计 400 万元的处罚：（一）不良贷款余额 EAST 数据存在偏差，（二）逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差，（三）漏报贸易融资业务 EAST 数据，（四）漏报抵押物价值 EAST 数据，（五）未报送权益类投资业务 EAST 数据等，共计 15 条违规行为。

招商银行（代码：600036）发行主体招商银行股份有限公司的如下违法违规事实于 2022 年 9 月 9 日受到中国银行保险监督管理委员会罚款合计 460 万元的处罚：（一）个人经营贷款挪用至房地产市场，（二）个人经营贷款“三查”不到位，（三）总行对分支机构管控不力承担管理责任等，共计 3 条违规行为。

22 建设银行 CD035（代码：112205035）发行主体中国建设银行股份有限公司因老产品规模在部分时点出现反弹的违法违规事实于 2022 年 9 月 30 日受到中国银行保险监督管理委员会罚款合计 200 万元的处罚。

22 中国银行 CD002（代码：112204002）发行主体中国银行股份有限公司因老产品规模在部分时点出现反弹的违法违规事实于 2022 年 5 月 26 日受到中国银行保险监督管理委员会罚款合计 200 万元的处罚。

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

除平安银行、招商银行、22 建设银行 CD035、22 中国银行 CD002 外，本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 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

基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

#### 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	29,846.07
2	应收清算款	155,983.08



3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	185,829.15

#### 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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 (%)
红塔红土盛利混合 A	70	3,376,097.55	235,471,389.58	99.64	855,439.08	0.36
红塔红土盛利混合 C	195	45,830.14	1,993,297.20	22.30	6,943,579.28	77.70
合计	265	925,523.42	237,464,686.78	96.82	7,799,018.36	3.18

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

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 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 (%)
----	------	------------	--------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	红塔红土盛利混合 A	231.36	0.0001
	红塔红土盛利混合 C	-	-
	合计	231.36	0.0001

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

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	红塔红土盛利混合 A	0
	红塔红土盛利混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	红塔红土盛利混合 A	0
	红塔红土盛利混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红塔红土盛利混合 A	红塔红土盛利混合 C
基金合同生效日（2021年8月2日）基金份额总额	220,072,193.21	213,144.23
本报告期期初基金份额总额	243,625,252.80	78,384,937.03
本报告期基金总申购份额	15,838,251.77	27,838,365.21
减：本报告期基金总赎回份额	23,136,675.91	97,286,425.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	236,326,828.66	8,936,876.48

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 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，基金管理人的重大人事变动如下：2022 年 1 月 13 日起，李凌先生担任公司首席信息官，同时辞任董事长，由总经理杨洁女士代理董事长职务。2022 年 1 月 27 日，由于公司第三届董事会任期届满，董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十。2022 年 2 月 21 日起，龚香林先生担任公司董事长，总经理杨洁女士不再代为履行公司董事长职责。2022 年 5 月 10 日起，段皓静女士离任督察长，龚香林先生代为履行督察长职责。2022 年 12 月 2 日起，杨洁女士兼任财务负责人；王园先生任公司督察长，王园先生不再担任公司副总经理；龚香林先生不再代为履行督察长职责。上述人事变动均由公司董事会审议通过，并按相关规定备案、公告。

本报告期内，基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为李开贞先生，向监管部门的相关报备手续正在办理中。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、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

本基金本报告期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

本基金管理人于 2022 年 3 月 21 日公告改聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）不再为本基金提供审计服务。该变更事项已由红塔红土基金管理有限公司第四届董事会第二次会议审议通过。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自 2022 年度起为本基金提供审计服务至今。报告期内应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为 50,000.00 元。

## 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

报告期内，本基金管理人及高级管理人员无收稽查或处罚等情况。

### 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
红塔证券	2	165,859,401.59	55.52	154,465.53	61.38	-
安信证券	1	132,901,712.40	44.48	97,190.98	38.62	-

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

### 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 (%)
红塔证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	58,967,588.80	100.00	917,900,000.00	100.00	-	-

### 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	关于红塔红土基金管理有限公司旗下部分基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月1日
2	关于红塔红土基金管理有限公司旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月1日
3	红塔红土基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月1日
4	红塔红土基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月14日
5	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月24日
6	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月24日
7	红塔红土基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月27日
8	红塔红土基金管理有限公司旗下基金产品风险等级划分结果（2021年	中国证监会指定报刊及网站	2022年1月27日

	下半年)		
9	关于红塔红土基金管理有限公司旗下部分基金参与泰信财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 2 月 21 日
10	红塔红土基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 2 月 22 日
11	红塔红土盛利混合型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 2 月 28 日
12	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金关联交易的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 8 日
13	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 21 日
14	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2021 年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 31 日
15	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2021 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 3 月 31 日
16	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
17	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
18	红塔红土盛利混合型证券投资基金招募说明书及产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
19	红塔红土盛利混合型证券投资基金更新招募说明书(2022 年 1 号)	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
20	红塔红土盛利混合型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
21	红塔红土盛利混合型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
22	红塔红土基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 5 月 12 日
23	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 20 日
24	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 20 日
25	红塔红土基金管理有限公司旗下基金产品风险等级划分结果(2022 年上半年)	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 26 日
26	红塔红土基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 31 日
27	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 31 日
28	红塔红土基金管理有限公司旗下基	中国证监会指定报刊及	2022 年 10 月 26 日

	金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	网站	
29	红塔红土盛利混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 10 月 26 日
30	红塔红土基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 12 月 3 日
31	红塔红土基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 12 月 3 日
32	红塔红土基金管理有限公司关于公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 12 月 28 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022-01-01 至 2022-12-31	109,999,900.00	0.00	0.00	109,999,900.00	44.85
	2	2022-01-01 至 2022-12-31	107,999,900.00	0.00	0.00	107,999,900.00	44.03
产品特有风险							
<p>1、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。</p> <p>2、流动性风险 基金在短期内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险。</p> <p>3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>4、基金净值大幅波动的风险 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>5、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>6、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p>							

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

### 13.2 存放地点

广东省深圳市前海深港合作区南山街道前湾一路 399 号前海嘉里商务中心四期 1 栋 2301

### 13.3 查阅方式

投资者可通过基金管理人网站，或在营业期间到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件。

在支付工本费后，投资者可取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

客服热线：4001-666-916（免长途话费）

公司网址：[www.htamc.com.cn](http://www.htamc.com.cn)

红塔红土基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日