

# 红土创新优淳货币市场基金 2018 年半年度报告摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：红土创新基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 23 日

## §1 重要提示

### 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 2018 年 8 月 21 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	红土创新优渥货币	
基金主代码	005150	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年9月8日	
基金管理人	红土创新基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	761,378,851.27份	
下属分级基金的基金简称:	红土创新优渥货币 A	红土创新优渥货币 B
下属分级基金的交易代码:	005150	005151
报告期末下属分级基金的份额总额	69,260,158.63份	692,118,692.64份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的收益。
投资策略	本基金运用利率预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略等积极的投资策略相结合，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略考虑各类资产的风险性、流动性及收益性特征，把风险控制在预算之内，在不增加风险的基础上保持高流动性，最终追求稳定的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 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	张洗尘
	联系电话	0755-33011878
	电子邮箱	zhangxc@htcfund.com
客户服务电话	0755-33011866	95559
传真	0755-33011855	021-62701216

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htcfund.com">http://www.htcfund.com</a>
----------------------	---

---

基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所
-------------	------------------

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	红土创新优渥货币 A	红土创新优渥货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日 )	报告期( 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	1,670,601.69	20,928,389.83
本期利润	1,670,601.69	20,928,389.83
本期净值收益率	2.2250%	2.3455%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2018 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	69,260,158.63	692,118,692.64
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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, 由于货币市场基金采用摊余成本法核算, 因此, 公允价值变动收益为零, 本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金收益分配为按日结转份额。

3. 本基金的基金合同生效日至本报告期末不满 1 年; 本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月, 建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

红土创新优渥货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3634%	0.0033%	0.0292%	0.0000%	0.3342%	0.0033%
过去三个月	1.0433%	0.0023%	0.0885%	0.0000%	0.9548%	0.0023%
过去六个月	2.2250%	0.0029%	0.1760%	0.0000%	2.0490%	0.0029%
自基金合同生效起至今	3.4376%	0.0030%	0.2878%	0.0000%	3.1498%	0.0030%

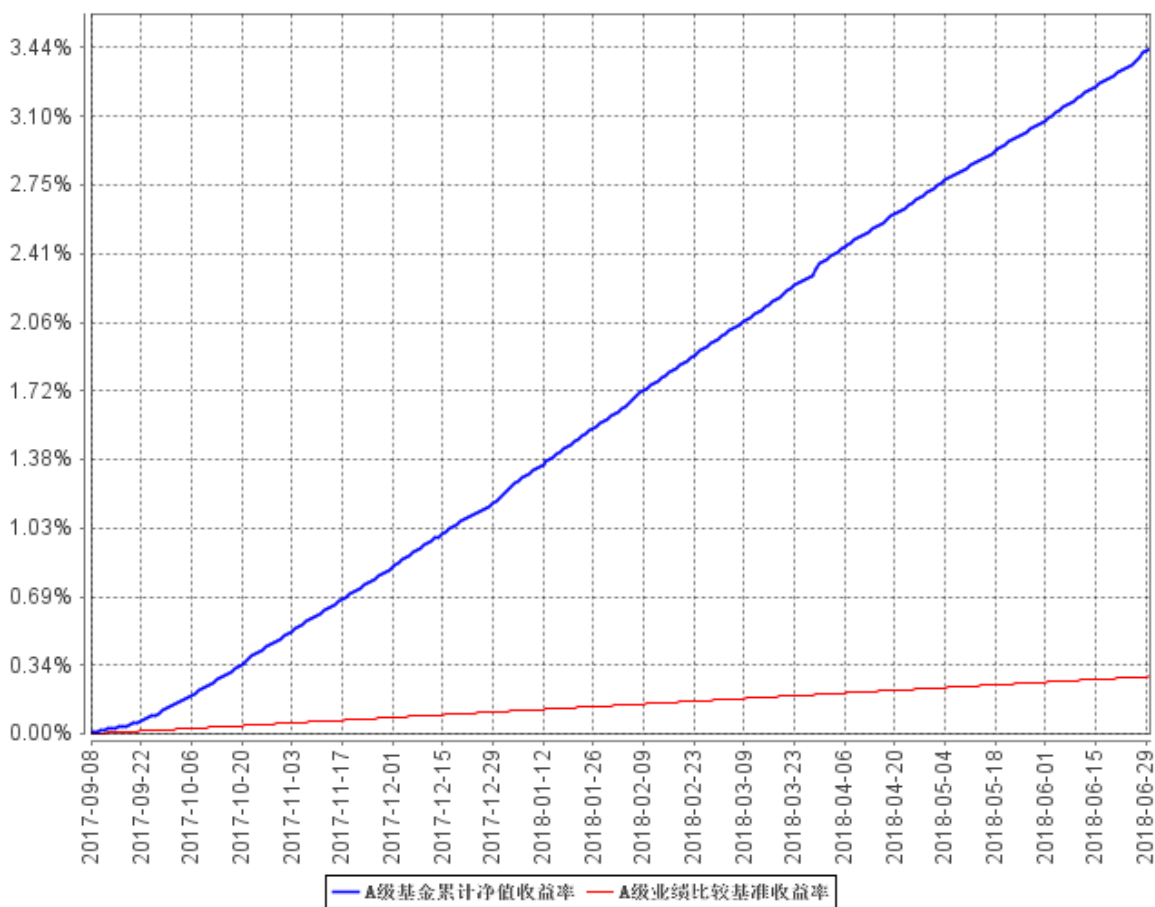
红土创新优渥货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

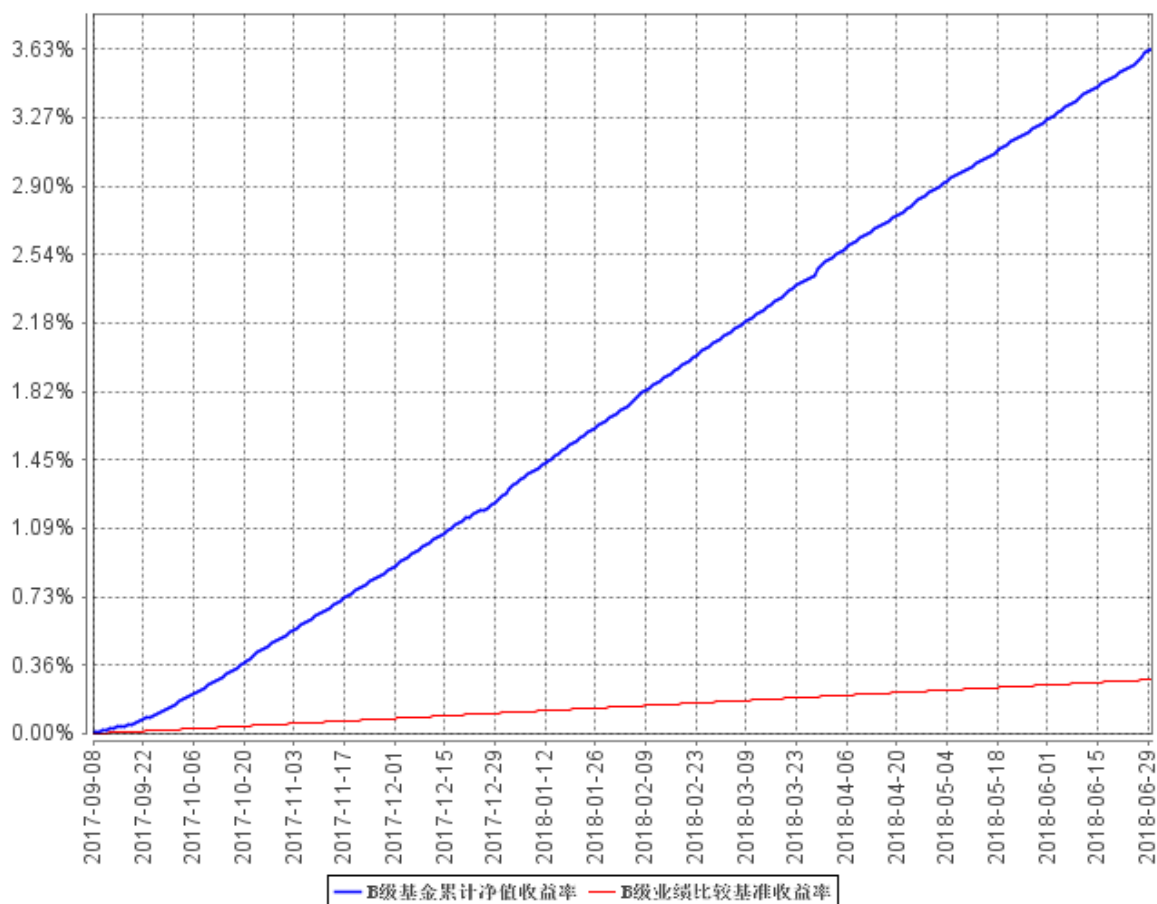
过去一个月	0.3831%	0.0033%	0.0292%	0.0000%	0.3539%	0.0033%
过去三个月	1.1040%	0.0023%	0.0885%	0.0000%	1.0155%	0.0023%
过去六个月	2.3455%	0.0029%	0.1760%	0.0000%	2.1695%	0.0029%
自基金合同生效起至今	3.6348%	0.0031%	0.2878%	0.0000%	3.3470%	0.0031%

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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日至本报告期末不满 1 年；本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

## §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，注册资本为 1.5 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 2018 年 6 月 30 日，红土创新基金共管理五只公募基金，资产管理规模 63.38 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		
梁戈伟	基金经理	2017 年 9 月 8 日	-	10	厦门大学金融学学士。十年公募基金从业经验，历任宝盈基金营销策划经理、高级交易员。现担任红土创新货币市场基金、红土创新优渥货币市场基金基金经理。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新优渥货币市场基金基金合同》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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 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

报告期内，国内经济呈现出供需分化的格局。从生产端来看，工业品价格持续增长，企业开工动能充足，规模以上工业增加值上半年实现了 6.7% 的增长，生产端仍保持相对稳定。从需求端来看，固定资产投资和社会消费品零售总额增速持续下滑，出口增速短期内处在高位但面临很大的潜在风险，需求总体表现较为疲弱。中美贸易冲突持续发酵，美方决定于 7 月 6 日起对中方出口的 340 亿美元商品加征 25% 的关税，后续潜在冲突规模可能进一步上升至 2000 亿美元乃至更高，这将对中国的出口和经济增长构成长期挑战。

报告期内，央行两次宣布实施定向降准，二季度货币政策委员会会议进一步提出要保持流动性合理充裕，流动性总体保持宽松，相比 2017 年下半年有明显改善。上半年金融监管持续推进，表外融资收缩剧烈，导致社会融资规模增速不断下滑，信用违约事件频发，实体经济面临的融资环境趋于恶化。

报告期内，本基金总体维持了较短久期的投资组合，根据资金面情况合理控制杠杆水平，在资金宽松时点适度小幅提升了组合杠杆和久期，并在收益率较高时点更加积极参与二级市场波段投资机会和一级市场配置机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期红土创新优渥货币 A 的基金份额净值收益率为 2.2250%，本报告期红土创新优渥货币 B 的基金份额净值收益率为 2.3455%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们预计国内经济将面临较大的下行压力。生产端，供给对价格的响应将逐步

趋于回落；需求端，居民部门加杠杆动力逐步减弱，房地产对消费的挤出效应不断显现，中美贸易冲突对出口部门的负面影响将开始体现。货币政策将继续保持相对宽松的状态，保持流动性合理充裕。政府出台的一系列“宽信用”政策预计对经济有一定的提振作用，但实际执行过程中信用条件的改善对经济增长发挥作用存在一定的滞后效应，下半年社融增速和经济景气度能否实现趋势性回升尚待进一步的观察。

下半年，本基金将继续做好流动性管理工作，及时跟踪基本面、市场流动性的走向和金融监管政策的动向，主动把握波段操作的机会，根据资金面水平合理调整组合久期和杠杆水平，积极参与同业存单和债券的一二级市场投资机会。

#### **4.6 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。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金合同约定，本基金根据每日基金收益情况，以各类基金份额的每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：1,670,601.69 元，向 B 级份额持有人分配利润：20,928,389.83 元。

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

本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

2018 年上半年，托管人在红土创新优渥货币市场基金的托管过程中，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

2018 年上半年，红土创新基金管理有限公司在红土创新优渥货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：1,670,601.69 元，向 B 级份额持有人分配利润：20,928,389.83 元。

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

2018 年上半年，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优渥货币市场基金的年度报告中财务指标、收益表现、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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：红土创新优淳货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	444,390.53	1,965,477.66
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	754,669,816.48	564,854,724.76
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	754,669,816.48	564,854,724.76
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	111,400,407.10	159,760,719.64
应收证券清算款	9,647,524.19	-
应收利息	6,183,250.20	1,713,003.14
应收股利	-	-
应收申购款	476,099.00	100.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	882,821,487.50	728,294,025.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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	-	-
卖出回购金融资产款	120,899,819.55	59,999,770.00
应付证券清算款	-	39,512,331.27
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	125,111.04	67,455.22
应付托管费	41,703.69	22,485.07
应付销售服务费	21,451.39	4,879.82
应付交易费用	57,145.93	35,854.52

应交税费	215.95	-
应付利息	26,618.94	42,090.30
应付利润	182,228.39	294,266.21
递延所得税负债	-	-
其他负债	88,341.35	100,500.00
负债合计	121,442,636.23	100,079,632.41
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	761,378,851.27	628,214,392.79
未分配利润	-	-
所有者权益合计	761,378,851.27	628,214,392.79
负债和所有者权益总计	882,821,487.50	728,294,025.20

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，红土创新优淳货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 69,260,158.63 份；红土创新优淳货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 692,118,692.64 份。红土创新优淳货币份额总额合计为 761,378,851.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：红土创新优淳货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	26,116,570.90
1.利息收入	24,664,063.41
其中：存款利息收入	35,526.43
债券利息收入	22,124,351.59
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,504,185.39
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,452,507.49
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	1,452,507.49
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
<b>减：二、费用</b>	3,517,579.38

1. 管理人报酬	733,622.75
2. 托管费	244,540.93
3. 销售服务费	140,613.96
4. 交易费用	-
5. 利息支出	2,278,244.59
其中：卖出回购金融资产支出	2,278,244.59
6. 税金及附加	515.11
7. 其他费用	120,042.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>22,598,991.52</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>22,598,991.52</b>

注：本基金自基金合同生效日（2017年9月8日）至报告期末不满一年，无上年度同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新优淳货币市场基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	628,214,392.79	-	628,214,392.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,598,991.52	22,598,991.52
三、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）	133,164,458.48	-	133,164,458.48
其中：1. 基金申购款	3,327,537,540.22	-	3,327,537,540.22
2. 基金赎回款	-3,194,373,081.74	-	-3,194,373,081.74
四、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）	-	-22,598,991.52	-22,598,991.52
五、期末所有者权益	761,378,851.27	-	761,378,851.27

(基金净值)			
--------	--	--	--

注：本基金自基金合同生效日（2017 年 9 月 8 日）至报告期末不满一年，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 高峰 _____	_____ 高峰 _____	_____ 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

红土创新优渥货币市场基金(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[2017]940号《关于准予红土创新优渥货币市场基金注册的批复》核准,由红土创新基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新优渥货币市场基金基金合同》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 440,009,284.00 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(2017)第 883 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新优渥货币市场基金基金合同》于 2017 年 9 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 440,009,284.00 份基金份额,无认购资金利息折合的基金份额。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。

根据《红土创新优渥货币市场基金基金合同》和《红土创新优渥货币市场基金招募说明书》的规定,本基金根据基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额类别。基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量小于 500 万份且按照 0.25%年费率计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量大于或等于 500 万份且按照 0.01%年费率计提销售服务费的基金份额,称为 B 类基金份额。A 类基金份额和 B 类基金份额单独设置基金代码,并分别公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新优渥货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为活期

存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司于 2018 年 8 月 23 日批准报出。

#### **6.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新优渥货币市场基金基金合同》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。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告完全一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 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。

##### **6.4.5.3 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。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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：

(a) 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 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。

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

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
红土创新基金管理有限公司（“红土创新”）	基金管理人、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
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。

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	733,622.75
其中：支付销售机构的客户维护费	106,639.71

注：1、支付基金管理人红土创新的管理人报酬按前一日基金资产净值 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

2、本基金自基金合同生效日（2017 年 9 月 8 日）至报告期末不满一年，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	244,540.93

注：1、支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

2、本基金自基金合同生效日（2017 年 9 月 8 日）至报告期末不满一年，无上年度同期对比数据。

### 6.4.8.2.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红土创新优渥货币 A	红土创新优渥货币 B	合计
红土创新	95,526.80	45,087.16	140,613.96
合计	95,526.80	45,087.16	140,613.96

注：1、支付基金销售机构的 A 类基金份额和 B 类基金份额的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值 0.25%和 0.01%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：

日销售服务费=前一日该类别基金资产净值×约定年费率 / 当年天数。

2、本基金自基金合同生效日（2017 年 9 月 8 日）至报告期末不满一年，无上年度同期对比数据。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
	红土创新优渥货币
基金合同生效日（2017 年 9 月 8 日）持有的基金份额	80,000,000.00
期初持有的基金份额	88,029,043.89
期间申购/买入总份额	45,374,755.72
期间因拆分变动份额	
减：期间赎回/卖出总份额	60,000,000.00
期末持有的基金份额	73,403,799.61
期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.6409%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 基金管理人红土创新在本会计期间认购/申购本基金适用的交易费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 6.4.8.4.2 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

注：无。

#### 6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	444,390.53	16,859.76

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额120,899,819.55元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111815262	18民生银行CD262	2018年7月2日	99.17	1,300,000	128,921,000.00
合计				1,300,000	128,921,000.00

### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，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中属于第二层次的余额为 754,669,816.48 元，无属于第一层次或第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

#### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中

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

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	754,669,816.48	85.48
	其中: 债券	754,669,816.48	85.48
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	111,400,407.10	12.62
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	444,390.53	0.05
4	其他各项资产	16,306,873.39	1.85
5	合计	882,821,487.50	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	14.66	
	其中: 买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	120,899,819.55	15.88
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注: 在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

注: 本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	33.04	15.88
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	2.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	75.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	3.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		115.07	15.88

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期限未超过 240 天。

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期限未超过 240 天。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	19,955,249.34	2.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	160,133,765.72	21.03
	其中：政策性金融债	160,133,765.72	21.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	574,580,801.42	75.47
8	其他	-	-
9	合计	754,669,816.48	99.12
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-



券		
---	--	--

## 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	130229	13 国开 29	1,300,000	130,030,088.43	17.08
2	111815262	18 民生银行 CD262	1,300,000	128,916,352.11	16.93
3	111806164	18 交通银行 CD164	1,000,000	99,033,455.98	13.01
4	111818148	18 华夏银行 CD148	900,000	89,278,084.66	11.73
5	111809171	18 浦发银行 CD171	700,000	69,438,592.14	9.12
6	111713102	17 浙商银行 CD102	500,000	49,511,131.34	6.50
7	130421	13 农发 21	300,000	30,103,677.29	3.95
8	111899588	18 盛京银行 CD230	300,000	29,697,278.66	3.90
9	111899919	18 重庆银行 CD109	300,000	29,692,593.50	3.90
10	111719357	17 恒丰银行 CD357	300,000	29,473,559.18	3.87

## 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1907%
报告期内偏离度的最低值	0.0187%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0691%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

## 7.8 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。

### 7.9.2

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

**7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	9,647,524.19
3	应收利息	6,183,250.20
4	应收申购款	476,099.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	16,306,873.39

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	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 优渥 货币 A	4,253	16,285.01	8,436,980.81	12.18%	60,823,177.82	87.82%
红土 创新 优渥 货币 B	22	31,459,940.57	651,923,516.83	94.19%	40,195,175.81	5.81%
合计	4,275	178,100.32	660,360,497.64	86.73%	101,018,353.63	13.27%

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	基金类机构	112,544,118.05	14.78
2	基金类机构	96,770,741.28	12.71
3	其他机构	90,523,511.16	11.89
4	基金类机构	73,403,799.61	9.64
5	基金类机构	61,830,793.78	8.12
6	基金类机构	50,402,986.02	6.62
7	其他机构	50,114,039.67	6.58
8	其他机构	30,030,021.92	3.94
9	其他机构	20,189,381.81	2.65
10	其他机构	15,185,033.83	1.99

**8.3 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	红土创新优渥货币 A	1,676,618.60	2.4208%
	红土创新优渥货币 B	-	-
	合计	1,676,618.60	0.2202%

**8.4 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的情况**

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	红土创新优渥货币 A	0~10
	红土创新优渥货币 B	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	红土创新优渥货币 A	-
	红土创新优渥货币 B	-
	合计	-

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

	红土创新优渥货币 A	红土创新优渥货币 B
基金合同生效日（2017年9月8日）基金份额总额	9,284.00	440,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,863,355.45	626,351,037.34
本报告期基金总申购份额	310,797,206.66	3,016,740,333.56
减：本报告期基金总赎回份额	243,400,403.48	2,950,972,678.26
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	69,260,158.63	692,118,692.64

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本公司原总经理杨兵先生因个人原因，于 2018 年 6 月 11 日离职，相关公告已于 2018 年 6 月 16 日在《证券时报》上披露。2018 年 7 月 17 日，公司再于《证券时报》上披露了“关于高级管理人员变更的公告”，高峰先生于 7 月 16 日任职公司总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

注：本基金本报告期无租用证券公司交易单元的有关情况。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180206	202,332,710.25	1,088,762.21	203,421,472.46	0.00	0%
	2	20180207-20180213	-	537,078,824.04	460,000,000.00	77,078,824.04	10%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包括红利再投资和份额折算。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司原总经理杨兵先生因个人原因，于 2018 年 6 月 11 日离职，相关公告已于 2018 年 6 月 16 日在《证券时报》上披露。2018 年 7 月 17 日，公司再于《证券时报》上披露了“关于高级管理人员变更的公告”，高峰先生于 7 月 16 日任职公司总经理。