

红塔红土人人宝货币市场基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：红塔红土基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 24 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	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合规守信情况的说明.....	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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 债券回购融资情况.....	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	43
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.....	44
7.9 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	49
10.9 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红塔红土人人宝货币市场基金	
基金简称	红塔红土人人宝货币	
场内简称	-	
基金主代码	002709	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 6 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	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	375,169,201.35 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	红塔红土人人宝货币 A	红塔红土人人宝货币 B
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	002709	002710
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	44,988,529.14 份	330,180,672.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（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。	
	红塔红土人人宝货币 A	红塔红土人人宝货币 B
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	李凌	郭明
	联系电话	0755-33379079	010-66105799
	电子邮箱	liling@htamc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4001-666-916（免长途话费）		95588
传真	0755-33379007		010-66105798
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）		北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801		北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518052		100140
法定代表人	刘辉		易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htamc.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	红塔红土基金管理有限公司	深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801

§ 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	红塔红土人人宝货币 A	红塔红土人人宝货币 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	625, 513. 08	6, 902, 994. 32
本期利润	625, 513. 08	6, 902, 994. 32
本期净值收益率	1. 9841%	2. 1052%
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	44, 988, 529. 14	330, 180, 672. 21
期末基金份额净值	1. 0000	1. 0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	6. 8852%	7. 4175%

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、本基金收益分配按日结转份额。

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

红塔红土人人宝货币 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. 3097%	0. 0006%	0. 1126%	0. 0000%	0. 1971%	0. 0006%
过去三个月	0. 9543%	0. 0010%	0. 3418%	0. 0000%	0. 6125%	0. 0010%
过去六个月	1. 9841%	0. 0008%	0. 6810%	0. 0000%	1. 3031%	0. 0008%
过去一年	3. 8819%	0. 0009%	1. 3781%	0. 0000%	2. 5038%	0. 0009%
自基金合同生效起至今	6. 8852%	0. 0021%	2. 8871%	0. 0000%	3. 9981%	0. 0021%

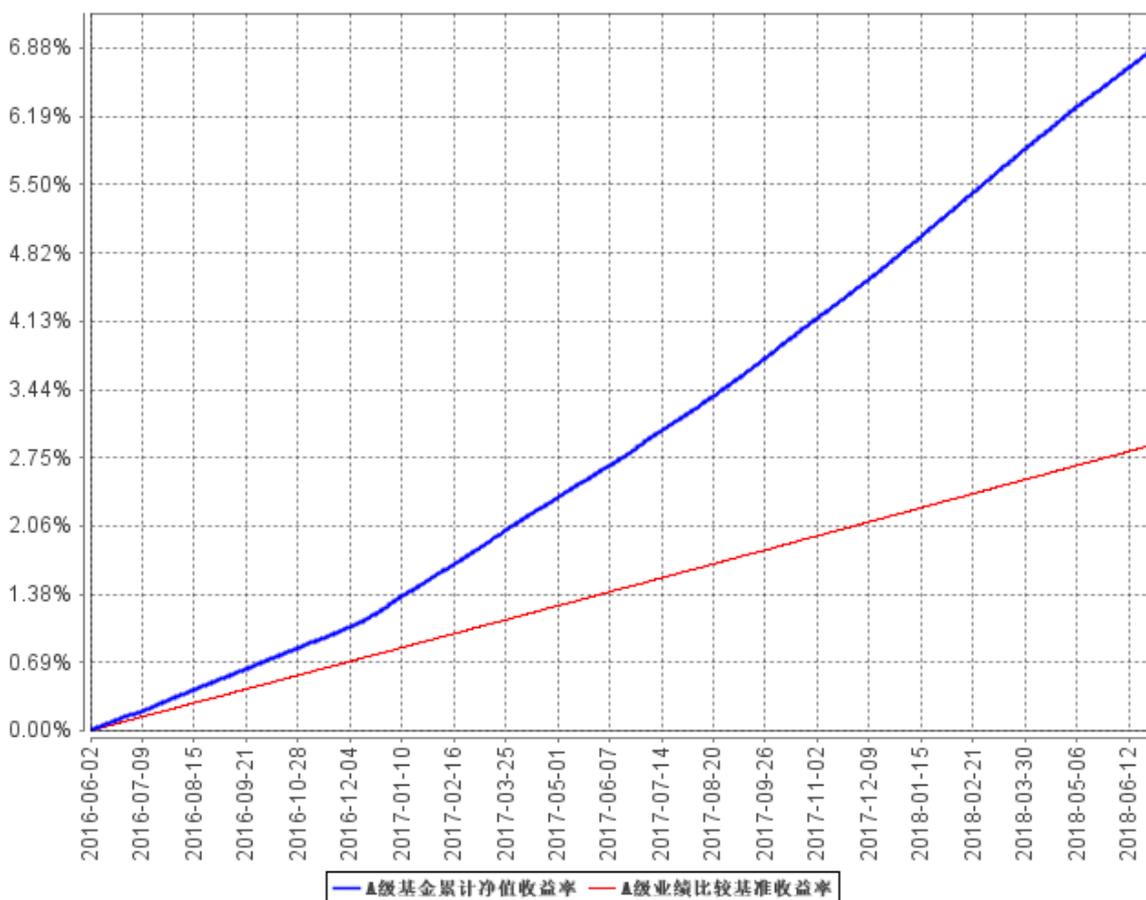
红塔红土人人宝货币 B

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	0.3294%	0.0006%	0.1126%	0.0000%	0.2168%	0.0006%
过去三个月	1.0145%	0.0010%	0.3418%	0.0000%	0.6727%	0.0010%
过去六个月	2.1052%	0.0008%	0.6810%	0.0000%	1.4242%	0.0008%
过去一年	4.1306%	0.0009%	1.3781%	0.0000%	2.7525%	0.0009%
自基金合同 生效起至今	7.4175%	0.0021%	2.8871%	0.0000%	4.5304%	0.0021%

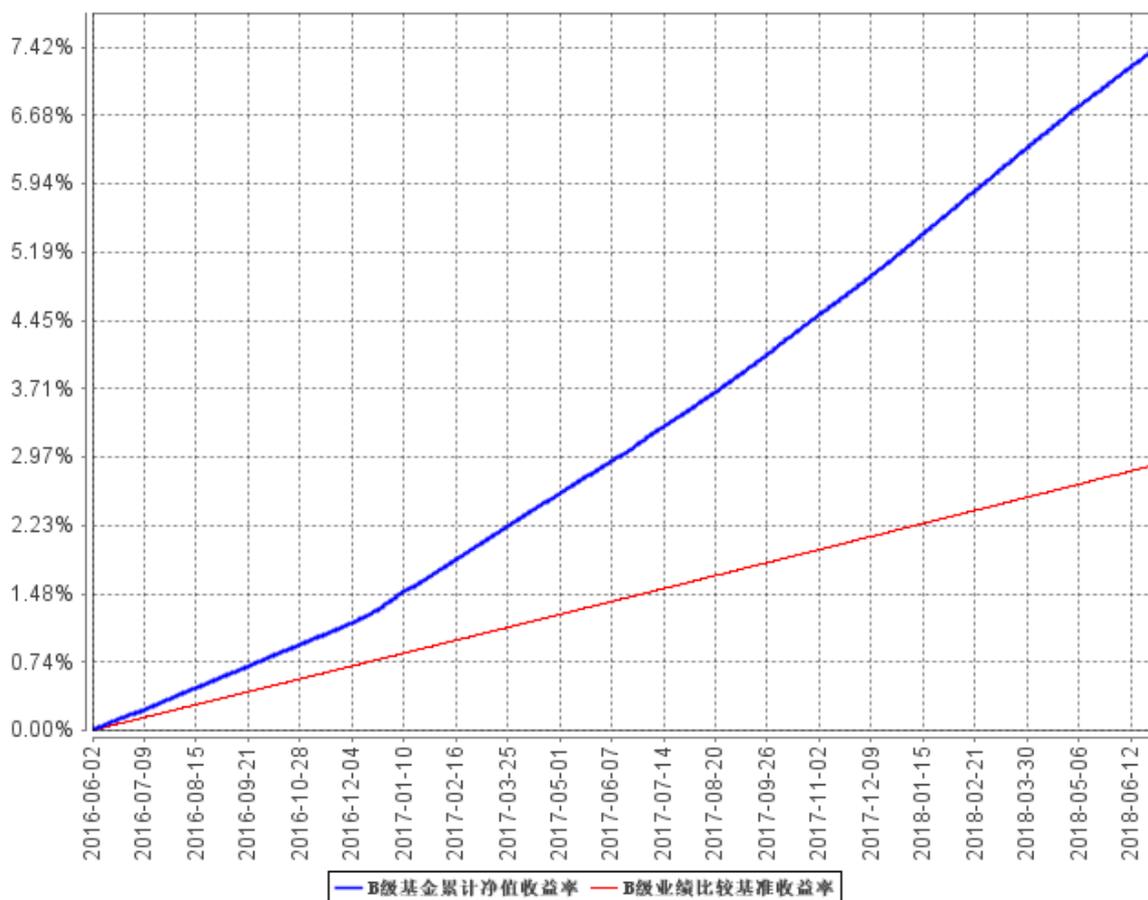
注：本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

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



3.3 其他指标

注：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%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

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，建立并不断完善投研一体化平台，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 2018 年 6 月 30 日，公司有员工 48 人，其中 33 人具有硕士或博士学位；截止 2018 年 6 月 30 日，公司管理 9 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		
赵耀	基金经理	2016 年 6 月 2 日	-	14	香港中文大学金融财务工商管理硕士，厦门大学经济学学士，CFA（美国注册金融分析师）。近 14 年证券、基金从业经历，历任诺安基金交易员、中国国际金融有限公司交易员，具有丰富的大资金运作交易经验。现任职公司投资部，为公司投资决策委员会委员。
罗薇	基金经理	2016 年 6 月 21 日	-	5	澳洲新南威尔士大学会计学硕士，北京大学理学学士，2012 年加入红塔红土基金研究部，现任职于公司投

					资部，为公司投资决策委员会委员。
--	--	--	--	--	------------------

注：证券从业年限的计算标准：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《红塔红土人人宝货币市场基金基金合同》、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。

4.3.2 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

今年上半年经济温和下行，2 月之后 CPI 保持较低位置，社融增速大幅下滑。今年上半工业增速保持基本稳定，同时固定资产投资、社会消费品零售总额和贸易差累计同比增速均大幅下滑，拉动需求的三驾马车动力均有所减弱。同时 CPI 在 2 月达到高点后逐步下滑，上半年 CPI 处于较低位置。此外今年以来社融同比增速持续下滑，实体经济去杠杆作用开始显现。整体来看今年经济增长动力不足，而随着棚改货币化安置政策收紧以及经济去杠杆继续推进，下半年基本面可能承压。

今年以来货币政策呈现边际宽松。今年上半央行继续通过灵活的公开市场操作对冲资金面收紧压力，同时于 4 月中旬和 6 月下旬两次宣布进行定向降准。其中 4 月 17 日，央行宣布自 2018 年 4 月 25 日起，下调大型商业银行、股份制商业银行、城市商业银行、非县域农村业银行、外资银行人民币存款准备金 1 个百分点，此次创新置换式降准累计将释放 1.3 万亿元流动性，其中 9000 亿用于偿还中期借贷便利，4000 亿为新增资金投放；6 月 25 日央行宣布自 7 月 5 日起下调存款准备金率 0.5 个百分点，用于支持市场化债转股及小微企业贷款项目，预计释放流动性 7000 亿元左右。

受货币政策边际宽松影响，今年以来资金面维持相对宽松。截至 6 月 26 日，R001、R007、R014 和 R1M 与本年初相比变动分别为-12BP、140BP、147BP 和 160BP，各期限存款类机构质押回购利率累计变动分别为-13BP、4BP、87BP 和 53BP，尽管临近半年末时点但短端资金面仍维持相对宽松，且存款类机构流动性更为充裕。除此之外，今年以来交易所资金利率累计变动幅度在-218BP 至 212BP 区间内，交易所资金利率变动更为显著但短端面同样维持相对宽松。

红塔红土人人宝货币市场基金作在 2018 年上半年以银行协议存款、同业存单、银行间及交易所回购为主要投资标的，在保证基金流动性的前提下，均匀安排资产到期期限，在市场条件较好的情况下适当增加杠杆提升基金收益。总体而言，人人宝货币基金流动性水平较好，投资标的均为 AAA 级品种或政策性金融债等高安全性资产，风险控制较好。在资金利率迅速下行的过程中，基金适当拉长久期以锁定部分高收益品种，取得较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期红塔红土人人宝货币 A 的基金份额净值收益率为 1.9841%，本报告期红塔红土人人

宝货币 B 的基金份额净值收益率为 2.1052%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。

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 2018 年下半年的中国经济，虽然短期来看中国经济整体韧性较强，但在投资、消费及出口同比增速均下滑的态势下，下半年经济行压力有所增大；而中美贸易摩擦问题的解决很难一蹴而就，贸易紧张局势或中长期持续存在，短期内恐打压投资者风险偏好。随着美国经济数据的持续向好，其退出量化宽松政策执行恐将继续，从而致使市场资金流动性有所承压；国内“去杠杆、防风险”致使债券违约频率明显增加，引发市场对于系统性风险的担忧。6 月央行实施定向降准政策从而缓解中小微企业的融资压力，但目前来看此举更多是“防范系统性风险”，而非意味着货币政策发行实质性转向。

对于 2018 年下半年的股票市场我们是谨慎乐观，站在当前的时点上，我们认为 A 股尚处于“存量消耗”的格局中，短期内受多重因素综合作用，A 股恐将经历反复磨底的过程。但从基本面来看，虽然受经济下行压力增大等因素影响，部分上市公司的盈利速恐将出现一定回落，但实际上近期市场大幅波动所受情绪面主导更多。随着恐慌情绪逐步消解、底部估值托底效应显现以及货币政策微调预期实施，中期来看市场反弹可期。

综合基本面、政策面以及海外扰动因素来看，今年下半年债券市场走势相对乐观，利率债和高等级信用债将有更好表现。其中今年以来需求明显收缩，下半年经济去杠杆及地产泡沫化将继续推进，经济基本面将承压；从政策面来看，实体经济流动性收缩的同时货币仍将维持边际宽松，下半年可能继续降准；从海外因素来看，一方面中美贸易争端持升级仍有可能推升短期避险情绪，另一方面由于国内政策独立性增强，中美利差走阔以及人民币汇率波动对国内政策面影响较小，海外因素不构成影响债券市场的主要因素。因此下半年债券市场走势不悲观，同时信用收缩以及企业盈利能力恶化背景下信用违约事件仍可继续发酵，且投资者风险偏好提高将进一步推升低等级信用利差，整体来看利率债和高等级信用债或将有更好表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理

公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

根据中国证监会的相关规定，本公司针对停牌股票、债券不活跃市场报价等投资品种启用特殊估值流程，由基金估值小组确定相应证券的估值方法。

估值小组成员包括公司领导、运营部门、法律、监察稽核部、研究部等相关人员。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与公司启用特殊估值的流程，发表相关意见和建议，与运营部门、公司领导、研究部相关人员共同商定估值原则和政策。

(3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期累计分配收益 7,528,507.40 元，利润分配金额、方式等符合相关法规和本基金基金合同的规定。

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 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，中国工商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对红塔红土人人宝货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，红塔红土人人宝货币市场基金的管理人——红塔红土基金管理有限公司在红塔红土人人宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

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红塔红土人人宝货币市场基金 2018 年半年度报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：红塔红土人人宝货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	224,646,255.60	163,363,503.81
结算备付金		399,090.91	825,909.09
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	119,434,962.20	168,280,379.73
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		119,434,962.20	168,280,379.73
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	47,040,178.56	7,000,123.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,391,043.48	1,723,222.36
应收股利		-	-
应收申购款		9,726.01	50,204.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		394,921,256.76	341,243,342.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		19,499,770.75	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		93,342.75	64,165.51
应付托管费		15,557.15	10,694.26
应付销售服务费		11,756.15	7,393.41
应付交易费用	6.4.7.7	6,949.77	3,689.48

应交税费		-	-
应付利息		6,582.90	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	118,095.94	259,000.00
负债合计		19,752,055.41	344,942.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	375,169,201.35	340,898,399.93
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		375,169,201.35	340,898,399.93
负债和所有者权益总计		394,921,256.76	341,243,342.59

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值人民币 1.0000 元，A 类基金份额 44,988,529.14 份；B 类基金份额净值人民币 1.0000 元，B 类基金份额 330,180,672.21 份，基金份额总额合计为 375,169,201.35 份。

6.2 利润表

会计主体：红塔红土人人宝货币市场基金

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	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		8,421,801.87	3,580,920.13
1.利息收入		8,380,684.04	3,607,411.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,618,822.65	2,155,188.35
债券利息收入		3,072,768.07	1,101,605.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		689,093.32	350,616.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		41,117.83	-26,491.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	41,117.83	-26,491.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
减: 二、费用		893,294.47	656,825.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	540,830.17	255,092.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	90,138.33	42,515.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	56,177.45	19,587.30
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		57,814.13	187,019.17
其中: 卖出回购金融资产支出		57,814.13	187,019.17
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	148,334.39	152,611.03
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		7,528,507.40	2,924,094.68
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		7,528,507.40	2,924,094.68

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 红塔红土人人宝货币市场基金

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)	340,898,399.93	-	340,898,399.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,528,507.40	7,528,507.40
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)	34,270,801.42	-	34,270,801.42
其中: 1. 基金申购款	654,560,189.27	-	654,560,189.27
2. 基金赎回款	-620,289,387.85	-	-620,289,387.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-7,528,507.40	-7,528,507.40

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	375,169,201.35	-	375,169,201.35
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	177,628,732.72	-	177,628,732.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,924,094.68	2,924,094.68
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）	-14,769,870.72	-	-14,769,870.72
其中：1. 基金申购款	329,965,093.55	-	329,965,093.55
2. 基金赎回款	-344,734,964.27	-	-344,734,964.27
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）	-	-2,924,094.68	-2,924,094.68
五、期末所有者权益（基金净值）	162,858,862.00	-	162,858,862.00

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：

_____ 刘辉 _____	_____ 许艺然 _____	_____ 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

红塔红土人人宝货币市场基金(以下简称“本基金”),系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[2016]757号《关于准予红塔红土人人宝货币市场基金注册的批复》的核准,由红塔红土基金管理有限公司(以下简称“红塔红土基金公司”)自2016年5月9

日至 2016 年 5 月 27 日向社会公开发行募集, 募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 验证并出具安永华明(2016) 验字第 61014670_H01 号验资报告后, 向中国证监会报送基金备案材料。本基金合同于 2016 年 6 月 2 日正式生效。本基金为契约型开放式基金, 存续期限不定。本基金的基金管理人为红塔红土基金公司, 注册登记机构为红塔红土基金公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

本基金主要投资于固定收益类金融工具, 包括现金、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、资产支持证券; 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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为: 同期七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 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、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制, 同时, 对于在具体会计核算和信息披露方面, 也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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 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 日止期间经营成果和净值变动情况。

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相一致。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 营业税、增值税、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，免征营业税。

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，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，自2018年1月1日起，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(以下简称“资管产品运营业务”)，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理

人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

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》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

(2) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	1,646,255.60
定期存款	223,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	10,000,000.00
存款期限 1-3 个月	31,000,000.00
存款期限 3 个月以上	182,000,000.00
其他存款	-
合计：	224,646,255.60

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	119,434,962.20	119,585,000.00	150,037.80	0.0400%
	合计	119,434,962.20	119,585,000.00	150,037.80	0.0400%
资产支持券		-	-	-	-
合计		-	-	-	-

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2018 年 6 月 30 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	39,040,178.56	-
合计	47,040,178.56	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	397.03

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2,409,234.23
应收结算备付金利息	179.60
应收债券利息	936,380.82
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	44,851.80
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	3,391,043.48

注：“其他存款利息”为应收协议存款利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末及上年度末均无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	6,949.77
合计	6,949.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	118,095.94
合计	118,095.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

红塔红土人人宝货币 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	27,158,693.66	27,158,693.66
本期申购	73,345,612.50	73,345,612.50
本期赎回(以“-”号填列)	-55,515,777.02	-55,515,777.02
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	44,988,529.14	44,988,529.14

金额单位：人民币元

红塔红土人人宝货币 B		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	313,739,706.27	313,739,706.27
本期申购	581,214,576.77	581,214,576.77
本期赎回(以“-”号填列)	-564,773,610.83	-564,773,610.83
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	330,180,672.21	330,180,672.21

注：本期申购包含红利再投资、分级调整以及基金转入的份额及金额；本期赎回包含分级调整以及基金转出的份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

红塔红土人人宝货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	625,513.08	-	625,513.08
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-625,513.08	-	-625,513.08
本期末	-	-	-

单位：人民币元

红塔红土人人宝货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	6,902,994.32	-	6,902,994.32
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-6,902,994.32	-	-6,902,994.32
本期末	-	-	-

注：本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每日以红利再投资方式集中支付收益，即按份额面值 1.00 元转为基金份额。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,268.21
定期存款利息收入	4,608,889.22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,665.22
其他	-
合计	4,618,822.65

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本期末无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	41,117.83
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	41,117.83

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	262,300,723.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	259,987,562.17
减：应收利息总额	2,272,043.84
买卖债券差价收入	41,117.83

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本期内无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本期内无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	84,300.75
账户维护费	18,000.00
银行费用	20,635.43
其他	603.02
合计	148,334.39

注：“其他”为上交所账户查询费。

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化。

6.4.9.2 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
红塔红土基金公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
工商银行	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、基金销售机构
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	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金于本期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日

当期发生的基金应支付的管理费	540,830.17	255,092.58
其中：支付销售机构的客户维护费	3,325.93	237.07

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	90,138.33	42,515.37

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 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		
	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		
	红塔红土人人宝货币 A	红塔红土人人宝货币 B	合计
红塔红土基金	33,552.18	16,330.74	49,882.92
红塔证券	254.63	0.00	254.63
合计	33,806.81	16,330.74	50,137.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土人人宝货币 A	红塔红土人人宝货币 B	合计

红塔红土基金	10,877.00	8,039.92	18,916.92
红塔证券	542.92	0.00	542.92
合计	11,419.92	8,039.92	19,459.84

注：本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额销售服务费年费率为 0.01%。基金销售服务费每日计提，按月支付。两类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$H = E \times \text{该基金份额的年销售服务费率} / \text{当年天数}$

H 为每日该类基金应计提的销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	
	红塔红土人人宝货币 A	红塔红土人人宝货币 B
期初持有的基金份额	-	9,338,996.17
期间申购/买入总份额	3,451,638.01	31,553,434.42
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	444,942.44	40,892,430.59
期末持有的基金份额	3,006,695.57	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.8014%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	红塔红土人人宝货币 A	红塔红土人人宝货币 B
期初持有的基金份额	-	26,758,666.85
期间申购/买入总份额	-	5,187,450.04
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	31,946,116.89
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.0000%

注：1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；
2、期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入及分级份额调增份额，期间赎回/卖出总份额：含转换出及分级份额调减份额。

6.4.10.4.2 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

红塔红土人人宝货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
北京市华远集团有限公司	31,887,501.81	8.4995%	31,226,256.54	9.1634%
深圳市红塔资产管理有 限公司	5,005,013.37	1.3341%	12,487,285.81	3.6644%

注：1、其他关联方持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、本期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金 A 类基金份额。

6.4.10.5 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		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,646,255.60	6,268.21	1,454,958.05	7,068.19

注：本基金本期的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

红塔红土人人宝货币 A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
625, 513. 08	-	-	625, 513. 08	-

红塔红土人人宝货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
6, 902, 994. 32	-	-	6, 902, 994. 32	-

6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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人民币 19, 499, 770. 75 元，是以如下债券作为质押：

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
111714258	17 江苏银行 CD258	2018 年 7 月 2 日	99. 27	100, 000	9, 927, 000. 00
111714282	17 江苏银行 CD282	2018 年 7 月 2 日	98. 92	100, 000	9, 892, 000. 00
111713104	17 浙商银行 CD104	2018 年 7 月 2 日	99. 84	10, 000	998, 400. 00
合计				210, 000	20, 817, 400. 00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

-

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程小组和相关业务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合规与风险管理委员会，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控制委员会，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，协调金融工程小组及其他各部门完成运作风险管理，并进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

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。

6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，并且通过分散化投资以降低信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,012,275.22	29,966,632.64
合计	30,012,275.22	29,966,632.64

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为债券期限小于等于一年的政策性金融债。

3、债券投资以摊余成本列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	79,422,686.98	138,313,747.09
合计	79,422,686.98	138,313,747.09

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、债券投资以摊余成本列示。

6.4.13.2.4 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	10,000,000.00	-
合计	10,000,000.00	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为债券期限大于一年的政策性金融债。

3、债券投资以摊余成本列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过相关部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在银行间同业市场交易，能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：-

6.4.13.3.2 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值、份额持有人集中度以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此，除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，均能够及时变现。本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余

到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等，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。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	97,646,255.60	117,000,000.00	10,000,000.00	-	-	-	224,646,255.60
结算备付金	399,090.91	-	-	-	-	-	399,090.91
交易性金融资产	29,978,209.28	39,773,333.64	49,683,419.28	-	-	-	119,434,962.20
买入返售金融资产	47,040,178.56	-	-	-	-	-	47,040,178.56
应收利息	-	-	-	-	-	3,391,043.48	3,391,043.48
应收申购款	-	-	-	-	-	9,726.01	9,726.01
资产总计	175,063,734.35	156,773,333.64	59,683,419.28	-	-	3,400,769.49	394,921,256.76
负债							
卖出回购金融资产款	19,499,770.75	-	-	-	-	-	19,499,770.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	93,342.75	93,342.75
应付托管费	-	-	-	-	-	15,557.15	15,557.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,756.15	11,756.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,949.77	6,949.77
应付利息	-	-	-	-	-	6,582.90	6,582.90
其他负债	-	-	-	-	-	118,095.94	118,095.94
负债总计	19,499,770.75	-	-	-	-	252,284.66	19,752,055.41

利率敏感度缺口	155,563,963.60	156,773,333.64	59,683,419.28	-	-	不适用	不适用
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	32,363,503.81	73,000,000.00	58,000,000.00	-	-	-	163,363,503.81
结算备付金	825,909.09	-	-	-	-	-	825,909.09
交易性金融资产	39,949,077.44	79,615,601.98	48,715,700.31	-	-	-	168,280,379.73
买入返售金融资产	7,000,123.50	-	-	-	-	-	7,000,123.50
应收利息	-	-	-	-	-	1,723,222.36	1,723,222.36
应收申购款	-	-	-	-	-	50,204.10	50,204.10
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	80,138,613.84	152,615,601.98	106,715,700.31	-	-	1,773,426.46	341,243,342.59
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,165.51	64,165.51
应付托管费	-	-	-	-	-	10,694.26	10,694.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,393.41	7,393.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,689.48	3,689.48
其他负债	-	-	-	-	-	259,000.00	259,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	344,942.66	344,942.66
利率敏感度缺口	80,138,613.84	152,615,601.98	106,715,700.31	-	-	不适用	不适用

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	79,256.17	-97,779.85
2. 市场利率上升 25 个基点	-79,068.11	97,992.22	

6.4.13.4.2 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。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于协议存款、定期存款、交易所及银

行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	119,585,000.00	31.87	168,092,000.00	49.31
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	119,585,000.00	31.87	168,092,000.00	49.31

注：-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金主要投资于同业存单、银行协议存款、银行间及交易所回购等固定收益品种，且以摊余成本法进行计价，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

(2) 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。

§ 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	119,434,962.20	30.24
	其中：债券	119,434,962.20	30.24
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	47,040,178.56	11.91
	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	225,045,346.51	56.98
4	其他各项资产	3,400,769.49	0.86
5	合计	394,921,256.76	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	1.20	
	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	-	-
	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	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

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	43.46	5.20
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	27.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	17.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	2.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	13.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.36	5.20

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,012,275.22	10.67
	其中：政策性金融债	40,012,275.22	10.67
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	79,422,686.98	21.17
8	其他	-	-
9	合计	119,434,962.20	31.83
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	180201	18 国开 01	200,000	19,991,991.41	5.33
2	180404	18 农发 04	100,000	10,020,283.81	2.67
3	110411	11 农发 11	100,000	10,000,000.00	2.67
4	111815134	18 民生银行 CD134	100,000	9,996,897.31	2.66
5	111713104	17 浙商银行 CD104	100,000	9,981,311.97	2.66
6	111896311	18 盛京银行 CD169	100,000	9,959,380.91	2.65
7	111891578	18 广州银行 CD017	100,000	9,957,814.53	2.65
8	111891614	18 贵阳银行 CD033	100,000	9,956,679.95	2.65
9	111714258	17 江苏银行 CD258	100,000	9,899,458.25	2.64
10	111714282	17 江苏银行 CD282	100,000	9,869,295.02	2.63

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	0.0845%
报告期内偏离度的最低值	0.0042%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0284%
------------------------	---------

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内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：本基金本报告期内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和折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值为 1.0000 元。

7.9.2

本报告期末，未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	-
3	应收利息	3,391,043.48
4	应收申购款	9,726.01
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,400,769.49

7.9.4 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。

§ 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
红塔红土人人宝货币 A	2,880	15,621.02	6,516,928.57	14.49%	38,471,600.57	85.51%
红塔红土人人宝货币 B	28	11,792,166.86	330,180,672.21	100.00%	0.00	0.00%
合计	2,908	129,012.79	336,697,600.78	89.75%	38,471,600.57	10.25%

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。

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	其他机构	31,887,501.81	8.50
2	其他机构	21,079,902.96	5.62
3	券商类机构	20,477,237.82	5.46
4	其他机构	20,047,524.07	5.34
5	其他机构	19,247,256.60	5.13
6	基金类机构	11,887,585.16	3.17
7	其他机构	10,603,187.94	2.83
8	券商类机构	10,277,533.69	2.74

9	券商类机构	10,223,724.97	2.73
10	信托类机构	10,213,003.97	2.72

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	红塔红土人人宝货币 A	6,163,749.72	13.7007%
	红塔红土人人宝货币 B	0.00	0.0000%
	合计	6,163,749.72	1.6429%

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）。

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	红塔红土人人宝货币 A	>100
	红塔红土人人宝货币 B	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	红塔红土人人宝货币 A	10~50
	红塔红土人人宝货币 B	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	红塔红土人人宝 货币 A	红塔红土人人宝 货币 B
基金合同生效日（2016 年 6 月 2 日）基金份 额总额	5,731,563.22	417,006,340.00
本报告期期初基金份额总额	27,158,693.66	313,739,706.27
本报告期基金总申购份额	73,345,612.50	581,214,576.77
减：本报告期基金总赎回份额	55,515,777.02	564,773,610.83
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	44,988,529.14	330,180,672.21

注：总申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额，总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。
基金托管人的专门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

报告期内无涉及本基金管理人、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

本基金本报告期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

本基金聘请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。本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
华创证券	1	-	-	-	-	-

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、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。

10.7.2 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
华创证券	-	-	558,900,000.00	100.00%	-	-

注：1、本报告期内本基金未发生交易所债券交易。

2、本报告期内本基金未发生交易所权证交易。

3、本报告期内本基金未发生交易所基金交易。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 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	红塔红土人人宝货币市场基金更新招募说明书及摘要（2018年第1号）	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年1月17日
2	红塔红土人人宝货币市场基金2017年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年1月22日
3	关于红塔红土基金管理有限公司旗下基金参与泰诚财富基金销售（大连）有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018年1月29日
4	关于红塔红土基金管理有限公司旗下基金参与大泰金石基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018年2月7日

5	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018年2月7日
6	关于红塔红土人人宝货币市场基金春节假期前暂停及节后恢复大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年2月10日
7	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018年2月13日
8	关于调整红塔红土人人宝货币市场基金基金份额升降级规则的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年3月9日
9	关于红塔红土人人宝货币市场基金修改基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年3月19日
10	红塔红土人人宝货币市场基金基金合同（2018年3月修订）	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年3月19日
11	红塔红土人人宝货币市场基金托管协议（2018年3月修订）	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年3月19日
12	红塔红土人人宝货币市场基金2017年度报告及摘要	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年3月27日
13	红塔红土人人宝货币市场基金2018年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年4月21日
14	关于红塔红土人人宝货币市场基金五一假期前暂停及节后恢复大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年4月26日
15	关于基金经理恢复履行职责的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018年6月13日
16	关于调整红塔红土人人宝货币市场基金快速赎回业务限额的公告	中国证券报、上海证券报、管理人网站	2018年6月26日
17	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018年6月26日

§ 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	2018-01-29 至 2018-02-06	0.00	80,304,349.26	80,304,349.26	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形，存在大额赎回可能导致的收益率波动风险，敬请投资者留意。							

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额，赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、红塔红土人人宝货币市场基金基金合同；
- 3、红塔红土人人宝货币市场基金托管协议；
- 4、红塔红土人人宝货币市场基金招募说明书；
- 5、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：广东省深圳市南山区侨香路 4068 号智慧广场 A 栋 801

基金托管人的办公场所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

12.3 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、基金托管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

红塔红土基金管理有限公司

2018 年 8 月 24 日