

# 红土创新优淳货币市场基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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.....	11
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.....	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 债券回购融资情况.....	40
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
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.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	42
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	42
7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	46
10.9 其他重大事件.....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>48</b>
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.....	48

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新优渥货币市场基金	
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	848,430,154.03 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	139,223,254.08 份	709,206,899.95 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	陆志俊
	联系电话	0755-33011878	021-58781234
	电子邮箱	zhangxc@htxfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		0755-33011866	95559
传真		0755-33011855	021-58408483
注册地址		广东省深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		518048	200336
法定代表人		高峰	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htcfund.com">http://www.htcfund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、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	红土创新基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 层

### § 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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	2,218,279.28	9,762,670.71
本期利润	2,218,279.28	9,762,670.71
本期净值收益率	1.2233%	1.3440%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末基金资产净值	139,223,254.08	709,206,899.95
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(2020年6月30日)	
累计净值收益率	9.3625%	10.0984%

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, 公允价值变动损益为零, 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	0.1326%	0.0026%	0.0292%	0.0000%	0.1034%	0.0026%
过去三个月	0.4572%	0.0038%	0.0885%	0.0000%	0.3687%	0.0038%
过去六个月	1.2233%	0.0043%	0.1769%	0.0000%	1.0464%	0.0043%
过去一年	2.5529%	0.0042%	0.3558%	0.0000%	2.1971%	0.0042%
自基金合同生效起至今	9.3625%	0.0041%	0.9985%	0.0000%	8.3640%	0.0041%

红土创新优渥货币 B

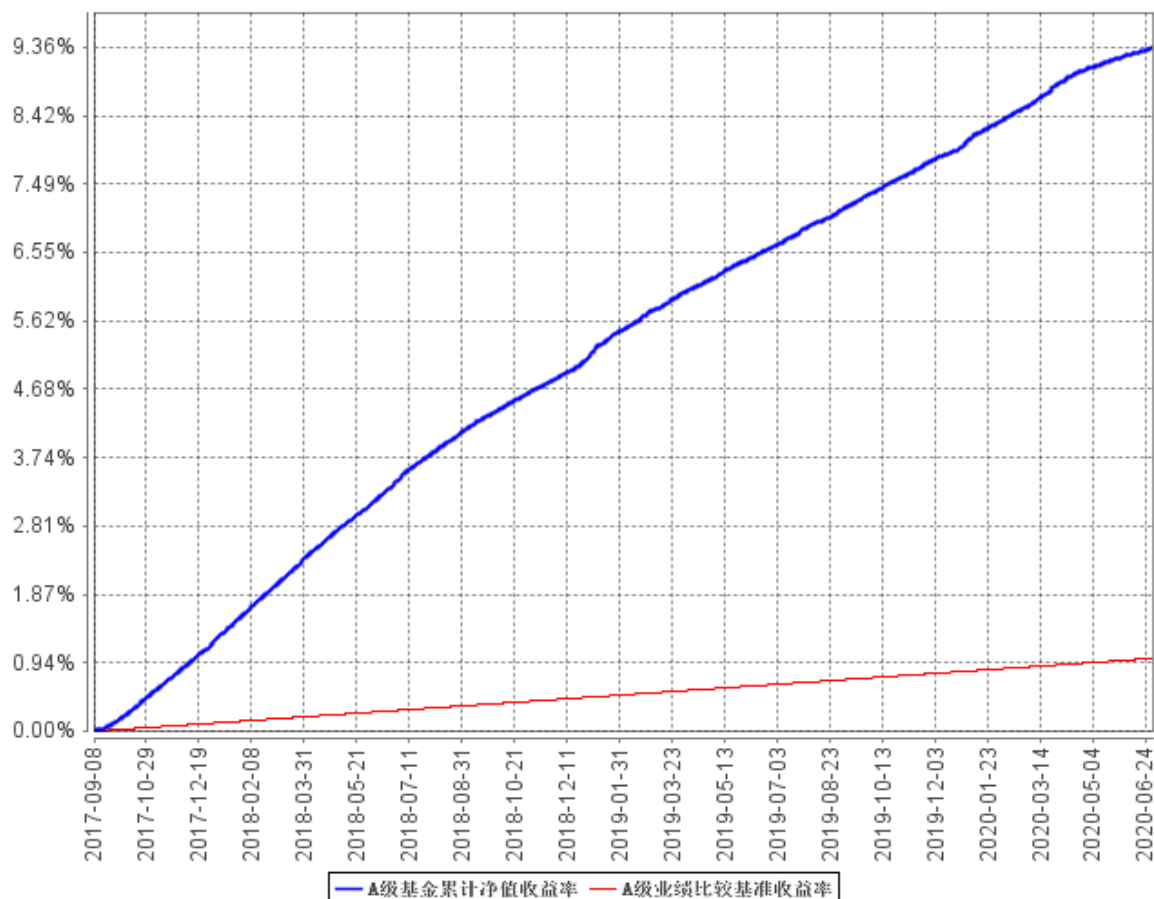
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1525%	0.0026%	0.0292%	0.0000%	0.1233%	0.0026%
过去三个月	0.5176%	0.0038%	0.0885%	0.0000%	0.4291%	0.0038%



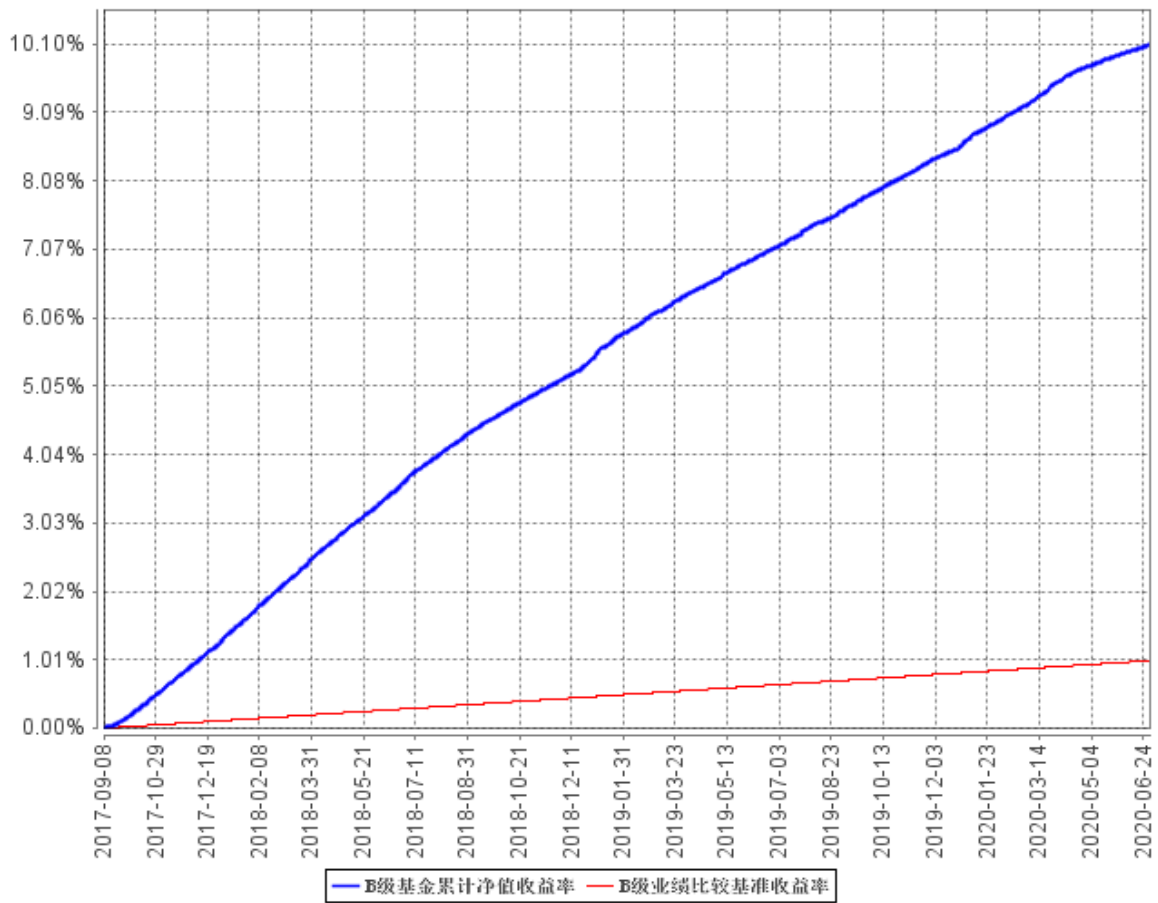
过去六个月	1.3440%	0.0043%	0.1769%	0.0000%	1.1671%	0.0043%
过去一年	2.7996%	0.0042%	0.3558%	0.0000%	2.4438%	0.0042%
自基金合同生效起至今	10.0984%	0.0041%	0.9985%	0.0000%	9.0999%	0.0041%

### 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。

### 3.3 其他指标

## § 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 4 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 2020 年 6 月 30 日，红土创新基金共管理 10 只公募基金，资产管理规模 77.48 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	2020 年 5 月 6 日	11	厦门大学金融学学士。历任宝盈基金营销策划经理、高级交易员。曾担任红土创新货币市场基金、红土创新优渥货币市场基金、红土创新增强收益债券型基金基金经理。
邱骏	基金经理	2019 年 3 月 19 日	-	9	厦门大学金融工程硕士，CPA，CFA。曾任宝盈基金研究员、宝盈货币市场基金基金经理、红土创新基金专户投资经理，现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合规守信情况的说明

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《证券投资基金管理人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，一季度新冠疫情的爆发，并在全球范围内快速传播，由此导致的贸易、人员、运输的阻断和停滞给全球经济和金融市场带来巨大负面影响。为缓解经济增长压力，世界各国纷纷采取不同程度的货币宽松政策和财政刺激政策，我国央行也先后采取了下调 MLF 利率、下调存款准备金率等在内的多种措施，为市场注入流动性，并努力谋求降低企业的融资成本。

报告期内，二季度随着我国疫情逐步得到有效控制，国内经济复产复工有序进行；部分海外国家情况也有所缓和，有限度开始重启经济。随着内外需的改善，国内主要经济数据环比出现明显回升。在此阶段，央行对于前期宽松货币政策的态度逐步趋于谨慎，在观察政策效果的同时，出于防控金融风险，防止资金套利空转目的，并未采取更为宽松的政策力度，仅在个别资金紧张时点投放流动性。

报告期内，债券市场收益率先下后上。一季度在悲观的经济预期、金融市场冲击带来的风险偏好降低以及充裕的流动性推动下，债券市场收益率继续大幅下行。二季度，随着央行货币政策基调边际收紧、宏观经济数据环比改善，同时利率债供给加速等因素，债券市场收益率出现快速、大幅上行，甚至回到疫情初的水平。

报告期内，在疫情爆发后收益率快速下行的阶段，我们整体采取了较高的组合久期和组合杠

杆，同时积极参与一二级市场投资机会。在报告期后半段市场收益率快速上行过程中，我们以维持组合的流动性为首要前提，整体采取了较低的组合久期和杠杆，降低利率风险。

#### 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 1.2233%，本报告期红土创新优渥货币 B 的基金份额净值收益率为 1.3440%，同期业绩比较基准收益率为 0.1769%。

#### 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，我们认为央行对货币政策宽松力度持有的谨慎态度、经济数据可能进一步环比改善、利率债的供给压力，以及权益市场的财富效应，都将继续压制资金对债券品种的风险偏好。但我们也认为，随着债券市场收益率的回升，在国内外经济整体仍缺乏有效动力、地缘政治风险加大以及疫情可能存在反复的情况下，债券市场的收益率将会出现阶段性投资机会，对此我们予以保持密切关注，在保持组合高流动性前提下，谨慎择优参与。

#### 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：2,218,279.28 元，向 B 级份额持有人分配利润：9,762,670.71 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

2020 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

2020 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：2,218,279.28 元，向 B 级份额持有人分配利润：9,762,670.71 元。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 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中期报告中财务指标、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：红土创新优渥货币市场基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	691,548.10	11,351,264.52
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	618,347,978.64	367,687,897.50
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		618,347,978.64	367,687,897.50
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	283,563,425.33	118,842,978.26
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,082,554.79	689,001.84
应收股利		-	-
应收申购款		372,994.54	133,099.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		905,058,501.40	498,704,241.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		55,999,652.00	77,799,592.40
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		14.85	-
应付管理人报酬		128,249.81	61,166.50
应付托管费		42,749.89	20,388.79
应付销售服务费		39,508.19	27,133.48
应付交易费用	6.4.7.7	111,401.61	53,471.74
应交税费		9,540.21	-

应付利息		8,786.36	8,150.62
应付利润		69,936.85	54,995.51
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	218,507.60	189,000.00
负债合计		56,628,347.37	78,213,899.04
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	848,430,154.03	420,490,342.27
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		848,430,154.03	420,490,342.27
负债和所有者权益总计		905,058,501.40	498,704,241.31

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，红土创新优渥货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 139,223,254.08 份；红土创新优渥货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 709,206,899.95 份。红土创新优渥货币份额总额合计为 848,430,154.03 份。

## 6.2 利润表

会计主体：红土创新优渥货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		14,373,021.53	12,649,904.28
1.利息收入		11,104,111.69	10,892,463.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,877.04	12,247.19
债券利息收入		7,937,412.07	7,539,423.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,149,822.58	3,340,792.53
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,268,909.84	1,757,440.63
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	3,268,909.84	1,757,440.63
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		2,392,071.54	1,930,332.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	735,307.60	527,359.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	245,102.52	175,786.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	275,507.31	246,540.51
4. 交易费用	6.4.7.19	100.00	671.45
5. 利息支出		1,005,346.66	855,912.77
其中：卖出回购金融资产支出		1,005,346.66	855,912.77
6. 税金及附加		6,526.40	2,034.00
7. 其他费用	6.4.7.20	124,181.05	122,027.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,980,949.99	10,719,571.96
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,980,949.99	10,719,571.96

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新优渥货币市场基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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）	420,490,342.27	-	420,490,342.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,980,949.99	11,980,949.99
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）	427,939,811.76	-	427,939,811.76
其中：1. 基金申购款	3,043,669,095.82	-	3,043,669,095.82
2. 基金赎回款	-2,615,729,284.06	-	-2,615,729,284.06
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	-	-11,980,949.99	-11,980,949.99

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	848,430,154.03	-	848,430,154.03
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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)	482,418,825.09	-	482,418,825.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,719,571.96	10,719,571.96
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)	85,261,768.90	-	85,261,768.90
其中：1. 基金申购款	1,550,447,209.05	-	1,550,447,209.05
2. 基金赎回款	-1,465,185,440.15	-	-1,465,185,440.15
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)	-	-10,719,571.96	-10,719,571.96
五、期末所有者权益(基金净值)	567,680,593.99	-	567,680,593.99

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：

<u>          高峰          </u>	<u>          高峰          </u>	<u>          焦小川          </u>
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》、《红土创新优渥货币市场基金招募说明书》和红土创新基金管理有限公司于 2019 年 12 月 5 日发布的《关于红土创新优渥货币市场基金取消自动升降级业务及降低 B 类份额申购起点的公告》，于 2019 年 12 月 10 日前，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。自 2019 年 12 月 10 日起，本基金取消基金份额自动升降级业务，即 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的登记机构将不再把该基金账户持有的 A 类基金份额自动升级为 B 类基金份额；B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的登记机构将不再把该基金账户持有的 B 类基金份额自动降级为 A 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；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)。

#### 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 重要会计政策和会计估计

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 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 2020年6月30日
活期存款	691,548.10
定期存款	-
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	-
合计:	691,548.10

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2020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	618,347,978.64	618,306,000.00	-41,978.64	-0.0049%
	合计	618,347,978.64	618,306,000.00	-41,978.64	-0.0049%
资产支持证券	-	-	-	0.0000%	
合计	618,347,978.64	618,306,000.00	-41,978.64	-0.0049%	

注:

- 1、偏离金额=影子定价-摊余成本；
- 2、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

无。

### 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 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	283,563,425.33	-
合计	283,563,425.33	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	110.55
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	2,002,592.81
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	79,851.43
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	2,082,554.79

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	111,401.61
合计	111,401.61

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 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	-
预提费用	218,507.60
合计	218,507.60

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

红土创新优渥货币 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	101,489,101.63	101,489,101.63
本期申购	522,991,803.00	522,991,803.00
本期赎回(以“-”号填列)	-485,257,650.55	-485,257,650.55
- 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	139,223,254.08	139,223,254.08

金额单位：人民币元

红土创新优渥货币 B		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	319,001,240.64	319,001,240.64
本期申购	2,520,677,292.82	2,520,677,292.82
本期赎回(以“-”号填列)	-2,130,471,633.51	-2,130,471,633.51
- 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	709,206,899.95	709,206,899.95

注：申购含红利再投、级别调整入份额。赎回含级别调整出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

红土创新优渥货币 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	2,218,279.28	-	2,218,279.28
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	-2,218,279.28	-	-2,218,279.28
本期末	-	-	-

单位：人民币元

红土创新优渥货币 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	9,762,670.71	-	9,762,670.71
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	-9,762,670.71	-	-9,762,670.71
本期末	-	-	-



**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	16,877.04
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	-
其他	-
合计	16,877.04

**6.4.7.12 股票投资收益**

无。

**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 2020年1月1日至2020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	3,268,909.84
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	3,268,909.84

**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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,904,011,246.85
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,867,365,157.67
减：应收利息总额	33,377,179.34
买卖债券差价收入	3,268,909.84

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

无。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

无。

**6.4.7.18 其他收入**

无。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	100.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	100.00

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间结算账户维护费	9,000.00
银行划付手续费	15,673.45
其他	400.00
上清所证书使用费	600.00
上清所结算账户维护费	9,000.00
合计	124,181.05

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须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

无。

##### 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、基金销售机构
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。

##### 6.4.10 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。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**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	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	735,307.60	527,359.56
其中：支付销售机构的客户维护费	156,336.07	87,823.61

注：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。

**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
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	245,102.52	175,786.60

注：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。

## 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 2020年1月1日至2020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	22,547.55	23,416.91	45,964.46
交通银行	18,579.76	1,735.55	20,315.31
合计	41,127.31	25,152.46	66,279.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	18,633.79	19,030.74	37,664.53
交通银行	14,011.05	-	14,011.05
合计	32,644.84	19,030.74	51,675.58

注：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。

## 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	150,088,280.28	210,007,357.30	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	30,811,674.66	-	45,000,000.00	22,006.85	-	-

#### 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	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）持有的基金份额	-	80,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-	42,941,580.55
报告期间申购/买入总份额	-	191,957,026.46
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	9,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	225,898,607.01
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	31.8523%

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	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）持有的基金份额	-	80,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-	66,421,362.53
报告期间申购/买入总份额	-	31,128,412.66
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	34,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	63,549,775.19
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	14.2036%

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。

**6.4.10.4.2 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**

无。

**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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
交通银行	691,548.10	16,877.04	386,784.48	12,247.19

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。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**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

## 红土创新优渥货币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
2,220,349.97	-	-2,070.69	2,218,279.28	-

## 红土创新优渥货币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
9,745,658.68	-	17,012.03	9,762,670.71	-

**6.4.12 期末（2020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**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

### 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 2019 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 82,667,518.67 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
012000867	20 中石化 SCP003	2020 年 7 月 1 日	99.96	497,000.00	49,679,311.27
012001160	20 首钢 SCP003	2020 年 7 月 1 日	100.07	100,000.00	10,006,850.81
合计				597,000	59,686,162.08

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 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。本基金主要投资于各类货币市场工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；在交易所进行的交易均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，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用评级在 AAA+ 级以下的债券，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值产的 10%。

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。

#### 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	249,855,629.87	30,124,794.18
A-1 以下	-	-
未评级	328,380,963.77	399,004,003.59
合计	578,236,593.64	429,128,797.77

注：未评级部分为同业存单。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

**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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	40,111,385.00	99,815,504.73
合计	40,111,385.00	99,815,504.73

注：未评级部分为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 55,999,652.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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(所有者权益)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。

### 6.4.13.3.1 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》、《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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券),并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天,平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天,且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天,平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2020 年 6 月 30 日,本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 78.92%,本基金投资组合的平均剩余期限为 69 天。

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的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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。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 10%。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流

动性情况良好。

注：流动性受限资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	691,548.10	-	-	-	691,548.10
交易性金融资产	598,277,962.27	20,070,016.37	-	-	618,347,978.64
买入返售金融资产	283,563,425.33	-	-	-	283,563,425.33
应收利息	-	-	-	-2,082,554.79	2,082,554.79
应收申购款	-	-	-	372,994.54	372,994.54
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	882,532,935.70	20,070,016.37	-	-2,455,549.33	905,058,501.40
负债					
卖出回购金融资产款	55,999,652.00	-	-	-	55,999,652.00
应付赎回款	-	-	-	14.85	14.85
应付管理人报酬	-	-	-	128,249.81	128,249.81
应付托管费	-	-	-	42,749.89	42,749.89
应付销售服务费	-	-	-	39,508.19	39,508.19

应付交易费用				111,401.61	111,401.61
应付利息				8,786.36	8,786.36
应交税费				9,540.21	9,540.21
应付利润				69,936.85	69,936.85
其他负债				218,507.60	218,507.60
负债总计	55,999,652.00			628,695.37	56,628,347.37
利率敏感度缺口	826,533,283.70	20,070,016.37		-1,826,853.96	848,430,154.03
上年度末 2019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	11,351,264.52				11,351,264.52
交易性金融资产	367,687,897.50				367,687,897.50
买入返售金融资产	118,842,978.26				118,842,978.26
应收利息				689,001.84	689,001.84
应收申购款				133,099.19	133,099.19
其他资产					
资产总计	497,882,140.28			822,101.03	498,704,241.31
负债					
卖出回购金融资产款	77,799,592.40				77,799,592.40
应付管理人报酬				61,166.50	61,166.50
应付托管费				20,388.79	20,388.79
应付销售服务费				27,133.48	27,133.48
应付交易费用				53,471.74	53,471.74
应付利息				8,150.62	8,150.62
应付利润				54,995.51	54,995.51
其他负债				189,000.00	189,000.00
负债总计	77,799,592.40			414,306.64	78,213,899.04
利率敏感度缺口	420,082,547.88			407,794.39	420,490,342.27

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。

#### 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	41.00	22.00
2. 市场利率上升 25 个基点	-41.00	-23.00	

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 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) 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 2020 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 618,347,978.64 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 2020 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	618,347,978.64	68.32
	其中:债券	618,347,978.64	68.32
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	283,563,425.33	31.33
	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	691,548.10	0.08
4	其他各项资产	2,455,549.33	0.27
5	合计	905,058,501.40	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	13.81	
	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	55,999,652.00	6.60
	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	69
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	40



### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	38.22	6.60
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	14.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	12.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	27.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		106.39	6.60

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	39,978,227.30	4.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,111,385.00	4.73
	其中：政策性金融债	40,111,385.00	4.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	249,855,629.87	29.45
6	中期票据	-	-
7	同业存单	288,402,736.47	33.99
8	其他	-	-

9	合计	618,347,978.64	72.88
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	112010226	20 兴业银行 CD226	700,000	69,635,299.73	8.21
2	012001341	20 宁波港 SCP001	500,000	49,985,588.10	5.89
3	012000867	20 中石化 SCP003	500,000	49,979,186.39	5.89
4	012002234	20 光大集团 SCP016	500,000	49,975,176.82	5.89
5	012001794	20 苏交通 SCP011	500,000	49,930,578.61	5.89
6	111904062	19 中国银行 CD062	500,000	49,910,277.81	5.88
7	111914195	19 江苏银行 CD195	500,000	49,634,117.93	5.85
8	111912115	19 北京银行 CD115	500,000	49,585,130.31	5.84
9	209918	20 贴现国债 18	400,000	39,978,227.30	4.71
10	111988579	19 重庆农村商行 CD239	300,000	29,849,549.38	3.52

## 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	0.2131%
报告期内偏离度的最低值	-0.0227%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0874%

### 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 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

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受到调查以及处罚的情况的说明

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	-
3	应收利息	2,082,554.79
4	应收申购款	372,994.54
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,455,549.33

## § 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	18,828	7,394.48	11,651,448.17	8.37%	127,571,805.91	91.63%
红土创新优渥货币 B	3,118	227,455.71	617,177,515.18	87.02%	92,029,384.77	12.98%
合计	21,730	39,044.19	628,828,963.35	74.12%	219,601,190.68	25.88%

### 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	65,697,250.09	7.74%
2	券商类机构	60,332,384.03	7.11%
3	其他机构	60,120,128.46	7.09%
4	其他机构	43,408,053.38	5.12%
5	其他机构	36,215,672.37	4.27%
6	其他机构	30,176,764.82	3.56%
7	其他机构	24,429,993.14	2.88%
8	其他机构	21,006,352.48	2.48%
9	其他机构	17,455,512.62	2.06%
10	个人	15,288,875.00	1.80%

### 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	43,931.16	0.0316%
	红土创新优渥货币 B	10,663,212.73	1.5035%

	合计	10,707,143.89	1.2620%
--	----	---------------	---------

#### 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	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	红土创新优渥货币 A	0~10
	红土创新优渥货币 B	0
	合计	0~10

## § 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	101,489,101.63	319,001,240.64
本报告期基金总申购份额	522,991,803.00	2,520,677,292.82
减：本报告期基金总赎回份额	485,257,650.55	2,130,471,633.51
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	139,223,254.08	709,206,899.95

## § 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

2020 年 1 月 17 日，经本公司董事会决议通过并经中国证监会核准，任命张键先生担任本公司董事长，公司总经理高峰先生不再代为行使董事长职责。相关公告已于 2020 年 1 月 18 日在《中国证券报》上披露。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

#### 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

无。

#### 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

无。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

### 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	红土创新优淳货币市场基金 2020 年春节假期前的申购提示 性公告	证券时报	2020 年 1 月 17 日
2	红土创新基金管理有限公司关	证券时报	2020 年 1 月 18

	于董事长变更的公告		日
3	红土创新基金管理有限公司关于使用自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	证券时报	2020年3月19日
4	红土创新优渥货币市场基金取消限制大额申购业务的公告	证券时报	2020年3月24日
5	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金新增汇林保大为销售机构的公告	证券时报	2020年3月25日
6	(清明)红土创新优渥货币市场基金 2020 年清明假期前的申购提示性公告	证券时报	2020年3月30日
7	红土创新优渥货币市场基金 2020 年五一假期前的申购提示性公告	证券时报	2020年4月23日
8	红土创新优渥货币市场基金调整大额申购业务的公告	证券时报	2020年5月6日
9	红土创新优渥货币市场基金变更基金经理的公告	证券时报	2020年5月8日
10	红土创新基金管理有限公司关于旗下基金新增海银基金为销售机构的公告	证券时报	2020年6月12日
11	红土创新优渥货币市场基金 2020 年端午假期前的申购提示性公告	证券时报	2020年6月22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	20200304-20200318	42,941,580.55	191,957,026.46	9,000,000.00	225,898,607.01	26.63%
	2	20200604-20200630	42,941,580.55	191,957,026.46	9,000,000.00	225,898,607.01	26.63%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

注：无。

### 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) 中国证监会核准红土创新优淳货币市场基金募集的文件；
- (2) 《红土创新优淳货币市场基金基金合同》；
- (3) 《红土创新优淳货币市场基金托管协议》；
- (4) 《红土创新优淳货币市场基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- (6) 报告期内红土创新优淳货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼

### 12.3 查阅方式

公司网站：[www.htcxfund.com](http://www.htcxfund.com)