

# 红土创新纯债债券型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	33

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	33
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	33
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	33
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	34
7.11 投资组合报告附注 .....	34
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>35</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	35
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>35</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	36
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 .....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	36
10.4 基金投资策略的改变 .....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	37
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 .....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	37
10.8 其他重大事件 .....	37
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>38</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 .....	38
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	38
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>38</b>
12.1 备查文件目录 .....	38
12.2 存放地点 .....	39
12.3 查阅方式 .....	39

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新纯债债券型证券投资基金	
基金简称	红土创新纯债	
基金主代码	009457	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 月 7 日	
基金管理人	红土创新基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	338,068,474.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	红土创新纯债 A	红土创新纯债 C
下属分级基金的交易代码	009457	009458
报告期末下属分级基金的份额总额	22,458,825.13 份	315,609,649.27 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在一定程度上控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为债券型基金，对债券的投资比例不低于基金资产的 80%。在此约束下，本基金通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低预期风险和预期收益的产品。

### 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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张洗尘	李帅帅
	联系电话	0755-33011878	0755-25878287
	电子邮箱	zhangxc@htcfund.com	LISHUAI@SHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		0755-33011866	95511-3
传真		0755-33011855	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 6 楼	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼

邮政编码	518048	518001
法定代表人	阮菲	谢永林

## 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.htcxfund.com">http://www.htcxfund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	红土创新纯债 A	红土创新纯债 C
本期已实现收益	109,149.60	4,839,445.27
本期利润	110,490.40	4,770,161.09
加权平均基金份额本期利润	0.0150	0.0219
本期加权平均净值利润率	1.45%	2.12%
本期基金份额净值增长率	2.49%	2.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	期末可供分配利润	12,325,674.20
	期末可供分配基金份额利润	0.0391
	期末基金资产净值	328,160,611.50

期末基金份额净值	1.0403	1.0398
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.03%	3.98%

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

红土创新纯债 A

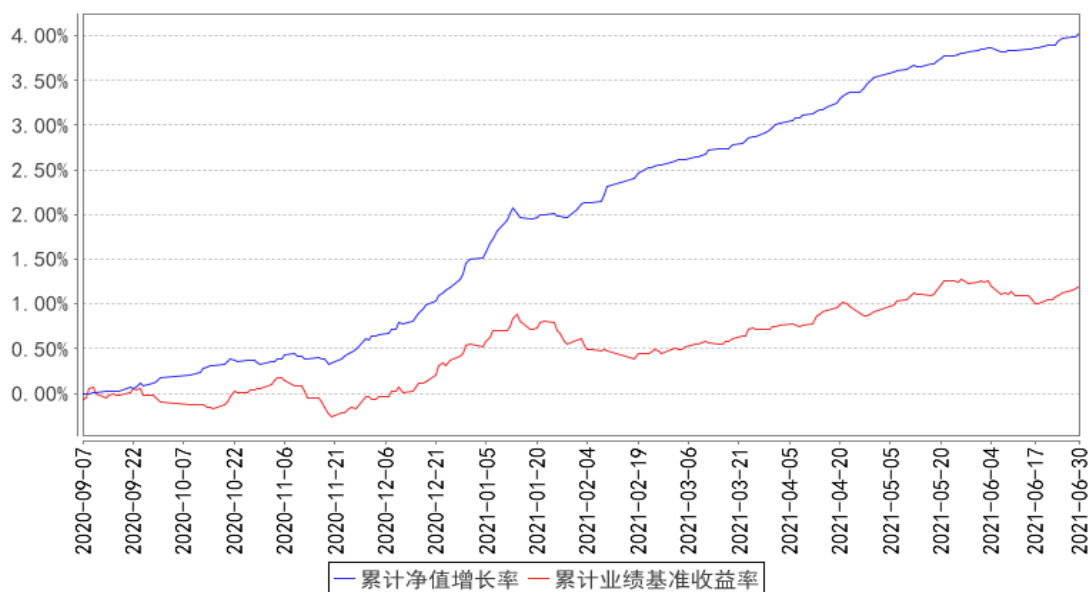
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.19%	0.02%	-0.04%	0.03%	0.23%	-0.01%
过去三个月	1.02%	0.02%	0.45%	0.03%	0.57%	-0.01%
过去六个月	2.49%	0.03%	0.65%	0.04%	1.84%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.03%	0.03%	1.20%	0.04%	2.83%	-0.01%

红土创新纯债 C

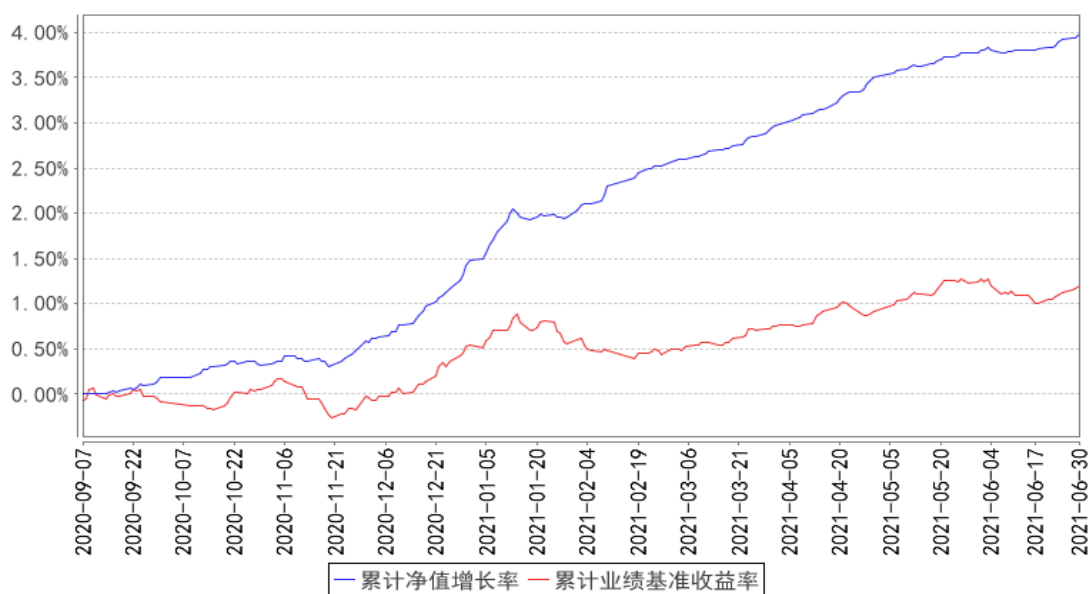
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.19%	0.02%	-0.04%	0.03%	0.23%	-0.01%
过去三个月	0.99%	0.02%	0.45%	0.03%	0.54%	-0.01%
过去六个月	2.46%	0.03%	0.65%	0.04%	1.81%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.98%	0.03%	1.20%	0.04%	2.78%	-0.01%

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

红土创新纯债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



红土创新纯债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

红土创新基金管理有限公司（以下简称“红土创新基金”）经中国证监会证监许可【2014】562号文批准设立。红土创新基金总部位于深圳，注册资本金为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 2021 年 6 月 30 日，红土创新基金共管理 14 只公募基金，资产管理规模 86.58 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		
邱骏	本基金的基金经理	2020 年 9 月 7 日	-	11 年	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、红土创新纯债债券型证券投资基金基金经理。

#### 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、《红土创新纯债债券型证券投资基金基金合同》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，国内疫情尽管局部散现，但整体稳定，而国外疫情持续受到变异毒株的影响，时有反复甚至加剧。国内疫情的稳定，为工业生产提供了有利环境，叠加海外经济刺激推动国内出口延续强劲，国内经济增长稳步回升。通胀方面，随着工业补库存的持续和碳中和政策的强化，再加上原油价格的大幅上涨，大宗商品价格出现明显上行，并推动 PPI 和 CPI 同比继续回升。通胀的快速反弹和疫情的反复，对消费需求和部分下游行业以及中小企业带来一定不利影响，二季度后半段经济增长逐步显现弱化迹象。整体看，报告期内，随着经济增长和通胀的持续反弹，央行对于货币政策基调延续中性稳健基调，并未做过多流动性投放。

报告期内，收益率走势先上后下。期初受春节前现金需求、缴税、市场对于央行可能收紧流动性的担忧等多重因素影响下，市场资金面整体较为紧张，债券收益率尤其是短端品种出现大幅上行；春节后，随着利率债供给低于预期，同时资金面趋于宽裕，加上政策层面多次对不急转的表态，债券市场逐步忽略对经济增长、通胀上行、美联储缩表等利空因素的警惕，在纠结中 10 年期国债收益率缓缓下行并突破春节前的最低水平到 3.04% 左右，1 年期国债收益率也最低下行至 2.3% 左右的水平。进入 6 月，随着市场对供给加大和资金收敛预期的增强，10 年期国债和 1 年期国债收益率分别较报告期内低点有所回调。

报告期内，春节前，由于债券市场依然存在较高的不确定性，我们整体保持了较低的组合久期，主要投资于 1 年期左右及以内的利率债券，并根据市场资金面变化情况，适时参与了波段交易。春节后，市场对各种影响因素预期的纠结，使得利率债收益率整体处于窄幅震荡下行走势，利率债的交易机会有限。由于资金面较为宽松，同时利率债缺乏趋势行情，二季度票息策略相对占有，信用债表现更好，信用利差不断压缩。由于利率债交易机会有限，对我们的利率债交易策略带来了部分压力，我们适当提高了参与波段交易的频率，以努力积少成多。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红土创新纯债 A 的基金份额净值为 1.0403 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%；截至本报告期末红土创新纯债 C 的基金份额净值为 1.0398 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.46%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

## 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，我们认为国内经济将延续增长态势，但动力或受前期信用压缩政策、局部疫情、通胀制约等因素影响会有所弱化。预计下半年财政支出将有所加快，财政后置的托底作用将在一定程度上缓解对经济快速回落的担忧。但伴随财政支出加快而来的地方债供给加速，可能给债券

供需和资金面带来潜在不利影响，对应配套的货币政策在量的角度预计将有所宽松，但价的角度预计不会出现明显调整。下半年左右市场的主要因素将表现为：中长端债券市场走势取决于政策预期和实际落地情况的博弈以及地方债发行进度；短端债券市场走势则更关注政策资金利率是否调整从而打开下行空间。目前看，市场对于政策、经济通胀仍有较大分歧，在上有顶和下有底的基本面支撑下，市场行情的演绎可能仍将在纠结中展开，窄幅震荡仍将是市场主题，需等待更为明确的政策或宏观数据信号。

#### 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

遵照本基金合同约定，本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 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

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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：红土创新纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,587,985.38	524,646.01
结算备付金		5,842,963.83	3,310,821.18
存出保证金		365,744.13	106,656.04
交易性金融资产	6.4.7.2	369,786,172.20	128,219,915.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		369,786,172.20	128,219,915.20
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	50,000,000.00	-
应收证券清算款		7,974,470.38	11,811,030.45
应收利息	6.4.7.5	3,121,833.99	1,604,343.03
应收股利		-	-
应收申购款		207,951.29	270,420.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		443,887,121.20	145,847,832.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	35,783,746.32
应付证券清算款		91,243,668.49	-
应付赎回款		667,589.66	-
应付管理人报酬		95,639.16	27,611.32
应付托管费		31,879.73	9,203.79

应付销售服务费		29,965.15	9,199.76
应付交易费用	6.4.7.7	143,717.28	45,039.58
应交税费		2,220.18	162.79
应付利息		-	2,514.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	148,260.89	100,000.00
负债合计		92,362,940.54	35,977,477.94
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	338,068,474.40	108,268,452.29
未分配利润	6.4.7.10	13,455,706.26	1,601,902.49
所有者权益合计		351,524,180.66	109,870,354.78
负债和所有者权益总计		443,887,121.20	145,847,832.72

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，红土创新纯债 A 基金份额净值 1.0403 元，基金份额总额 22,458,825.13 份；红土创新纯债 C 基金份额净值 1.0398 元，基金份额总额 315,609,649.27 份。红土创新纯债份额总额合计为 338,068,474.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：红土创新纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		6,285,464.02
1. 利息收入		3,429,539.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	31,168.45
债券利息收入		3,371,431.08
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		26,939.52
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,920,912.64
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	2,920,912.64
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	-67,943.38

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	2, 955. 71
减：二、费用		1, 404, 812. 53
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	342, 331. 10
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	114, 110. 38
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	110, 552. 30
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	219, 790. 47
5. 利息支出		502, 467. 18
其中：卖出回购金融资产支出		502, 467. 18
6. 税金及附加		300. 95
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	115, 260. 15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4, 880, 651. 49
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4, 880, 651. 49

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红土创新纯债债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	108, 268, 452. 29	1, 601, 902. 49	109, 870, 354. 78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4, 880, 651. 49	4, 880, 651. 49
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）	229, 800, 022. 11	6, 973, 152. 28	236, 773, 174. 39
其中：1. 基金申购款	409, 375, 417. 07	13, 164, 981. 78	422, 540, 398. 85
2. 基金赎回款	-179, 575, 394. 96	-6, 191, 829. 50	-185, 767, 224. 46
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）	-	-	-

五、期末所有者 权益(基金净值)	338,068,474.40	13,455,706.26	351,524,180.66
---------------------	----------------	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告一至财务报表由下列负责人签署：

阮菲

周厚桥

焦小川

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

红土创新纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]475号《关于准予红土创新纯债债券型证券投资基金注册的批复》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《红土创新纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 210,341,384.51 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(2020)第 0796 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《红土创新纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 210,342,365.04 份基金份额,其中认购资金利息折合 980.53 份基金份额。本基金的基金管理人为红土创新基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《红土创新纯债债券型证券投资基金基金合同》和《红土创新纯债债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,不计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取前端认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《红土创新纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为：投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

#### 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》、《红土创新纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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

本基金本报告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本报告期末的财务状况以及本报告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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 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：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 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 2021年6月30日
活期存款	6,587,985.38
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	6,587,985.38

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	118,708,381.50	118,716,172.20
	银行间市场	251,005,506.25	251,070,000.00
	合计	369,713,887.75	369,786,172.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	369,713,887.75	369,786,172.20	72,284.45

#### 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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	50,000,000.00	-

##### 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 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,988.42
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	2,629.30
应收债券利息	3,117,051.67
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	164.60
合计	3,121,833.99

## 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 2021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	143,717.28
合计	143,717.28

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.74
应付证券出借违约金	-
预提费用	148,260.15
合计	148,260.89

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 红土创新纯债 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	104,602.44	104,602.44
本期申购	22,935,705.99	22,935,705.99
本期赎回（以“-”号填列）	-581,483.30	-581,483.30
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	22,458,825.13	22,458,825.13

## 红土创新纯债 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	108,163,849.85	108,163,849.85
本期申购	386,439,711.08	386,439,711.08
本期赎回（以“-”号填列）	-178,993,911.66	-178,993,911.66
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	315,609,649.27	315,609,649.27

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

红土创新纯债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,433.90	136.19	1,570.09
本期利润	109,149.60	1,340.80	110,490.40
本期基金份额交易产生的变动数	779,322.69	13,360.85	792,683.54
其中：基金申购款	798,130.68	13,659.67	811,790.35
基金赎回款	-18,807.99	-298.82	-19,106.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	889,906.19	14,837.84	904,744.03

红土创新纯债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,459,473.45	140,858.95	1,600,332.40
本期利润	4,839,445.27	-69,284.18	4,770,161.09
本期基金份额交易产生的变动数	6,026,755.48	153,713.26	6,180,468.74
其中：基金申购款	12,108,060.06	245,131.37	12,353,191.43
基金赎回款	-6,081,304.58	-91,418.11	-6,172,722.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,325,674.20	225,288.03	12,550,962.23

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	15,268.52
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	13,836.61

其他	2,063.32
合计	31,168.45

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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 2021年1月1日至2021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	2,920,912.64
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	2,920,912.64

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,779,059,356.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,685,988,870.02
减：应收利息总额	90,149,573.77
买卖债券差价收入	2,920,912.64

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

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-67,943.38
股票投资	-
债券投资	-67,943.38
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-67,943.38

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,955.71
合计	2,955.71

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,740.47
银行间市场交易费用	214,050.00
合计	219,790.47

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上清所证书使用费	500.00
上清所债券托管帐户维护费	12,000.00
中债登债券托管帐户维护费	13,500.00
合计	115,260.15

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	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
深创投红土资产管理（深圳）有限公司（“深创投红土资管”）	基金管理人的全资子公司

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

无。

##### 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
	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	342,331.10
其中：支付销售机构的客户维护费	14,053.41

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 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.3\% / \text{当年天数}。$$

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	114,110.38

注：1、支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

## 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		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红土创新纯债 A	红土创新纯债 C	合计
红土创新	-	101,252.76	101,252.76
合计	-	101,252.76	101,252.76

注：支付基金管理人红土创新的 C 类销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.100% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日 C 类销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行	6,587,985.38	15,268.52

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末(2021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

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

#### 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

本基金属于债券型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 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人平安银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 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。

##### 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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

#### **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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	6,587,985.38	-	-	-	6,587,985.38
结算备付金	5,842,963.83	-	-	-	5,842,963.83
存出保证金	365,744.13	-	-	-	365,744.13
交易性金融资产	369,786,172.20	-	-	-	369,786,172.20
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	50,000,000.00
应收利息	-	-	-	3,121,833.99	3,121,833.99
应收申购款	-	-	-	207,951.29	207,951.29
应收证券清算款	-	-	-	7,974,470.38	7,974,470.38
资产总计	432,582,865.54	-	-	11,304,255.66	443,887,121.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	667,589.66	667,589.66
应付管理人报酬	-	-	-	95,639.16	95,639.16
应付托管费	-	-	-	31,879.73	31,879.73
应付证券清算款	-	-	-	91,243,668.49	91,243,668.49
应付销售服务费	-	-	-	29,965.15	29,965.15
应付交易费用	-	-	-	143,717.28	143,717.28
应交税费	-	-	-	2,220.18	2,220.18
其他负债	-	-	-	148,260.89	148,260.89
负债总计	-	-	-	92,362,940.54	92,362,940.54
利率敏感度缺口	432,582,865.54	-	-	-81,058,684.88	351,524,180.66
上年度末 2020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	524,646.01	-	-	-	524,646.01
结算备付金	3,310,821.18	-	-	-	3,310,821.18
存出保证金	106,656.04	-	-	-	106,656.04
交易性金融资产	68,285,915.20	59,934,000.00	-	-	128,219,915.20
应收证券清算款	-	-	-	11,811,030.45	11,811,030.45
应收利息	-	-	-	1,604,343.03	1,604,343.03
应收申购款	-	-	-	270,420.81	270,420.81
资产总计	72,228,038.43	59,934,000.00	-	13,685,794.29	145,847,832.72
负债					
卖出回购金融资产款	35,783,746.32	-	-	-	35,783,746.32
应付管理人报酬	-	-	-	27,611.32	27,611.32
应付托管费	-	-	-	9,203.79	9,203.79
应付销售服务费	-	-	-	9,199.76	9,199.76
应付交易费用	-	-	-	45,039.58	45,039.58
应付利息	-	-	-	2,514.38	2,514.38
应交税费	-	-	-	162.79	162.79

其他负债	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	35,783,746.32	-	-	193,731.62	35,977,477.94
利率敏感度缺口	36,444,292.11	59,934,000.00	-	13,492,062.67	109,870,354.78

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 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		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	15.60	30.81
	2. 市场利率上升 25 个基点	-15.54	-30.66

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或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 2021 年 06 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 369,786,172.20 元，无属于第一或第三层次的余额。

(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 2021 年 06 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) 除公允价值外，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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	369,786,172.20	83.31
	其中：债券	369,786,172.20	83.31
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	50,000,000.00	11.26
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,430,949.21	2.80
8	其他各项资产	11,669,999.79	2.63
9	合计	443,887,121.20	100.00



## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

无。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

无。

## 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	278,811,172.20	79.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,975,000.00	25.88
	其中：政策性金融债	90,975,000.00	25.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	369,786,172.20	105.20

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	210006	21 付息国债 06	1,300,000	130,039,000.00	36.99
2	120410	12 农发 10	700,000	70,973,000.00	20.19
3	019645	20 国债 15	705,280	70,746,636.80	20.13
4	019640	20 国债 10	343,380	34,338,000.00	9.77
5	190003	19 付息国债 03	200,000	20,048,000.00	5.70

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

无。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体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。

**7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

无。

**7.11.3 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	365,744.13
2	应收证券清算款	7,974,470.38
3	应收股利	-
4	应收利息	3,121,833.99
5	应收申购款	207,951.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,669,999.79

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

无。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

无。

**7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

## § 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（%）
红土创新纯债 A	172	130,574.56	19,298,465.70	85.93	3,160,359.43	14.07
红土创新纯债 C	396	796,994.06	294,579,320.47	93.34	21,030,328.80	6.66
合计	559	604,773.66	313,877,786.17	92.84	24,190,688.23	7.16

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	红土创新纯债 A	99.79	0.0004
	红土创新纯债 C	24,119.63	0.0076
	合计	24,219.42	0.0072

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	红土创新纯债 A	0
	红土创新纯债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	红土创新纯债 A	0
	红土创新纯债 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红土创新纯债 A	红土创新纯债 C
基金合同生效日 （2020 年 9 月 7 日） 基金份额总额	34,734.79	210,307,630.25

本报告期期初基金份额总额	104,602.44	108,163,849.85
本报告期基金总申购份额	22,935,705.99	386,439,711.08
减：本报告期基金总赎回份额	581,483.30	178,993,911.66
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	22,458,825.13	315,609,649.27

## § 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

2021年4月29日，经本公司董事会决议通过并经中国证监会核准，任命冀洪涛先生担任本公司总经理，公司董事长阮菲女士不再代为行使总经理职责。2021年4月30日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

2021年4月29日，经公司第二届董事会第十六次会议决议通过，同意程志田先生于2021年5月7日辞去副总经理职务。2021年5月7日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

2021年5月21日，经工商行政管理部门核准，红土创新基金管理有限公司法定代表人变更为阮菲女士。2021年5月26日，公司在《证券时报》上刊登《红土创新基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》。

2021年1月26日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021年2月26日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	-	-	-	-	-

#### 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	5,676,736,917.80	100.00%	701,100,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	红土创新基金管理有限公司关于终止部分基金销售公司办理本公司旗下基金销售业务的提示	证券时报、公司网站	2021年01月22日
2	红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2021年04月30日
3	红土创新基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2021年05月07日
4	红土创新基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证券时报、公司网站	2021年05月26日
5	红土创新纯债债券型证券投资基金分红公告	证券时报、公司网站	2021年07月02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	20210101-20210328 20210330-20210520 20210601-20210630	30,000,000.00	77,760,497.67	30,000,000.00	77,760,497.67	23.00
	2	20210101-20210407	50,000,000.00	-	-	50,000,000.00	14.79
	3	20210329-20210329 20210408-20210520		-97,125,320.16	67,125,320.16	30,000,000.00	8.87
	4	20210521-20210630		-96,432,015.43	-	-96,432,015.43	28.52

#### 产品特有风险

##### 1. 巨额赎回风险

(1) 本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响；

(2) 单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

##### 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

##### 3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险。

### 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) 中国证监会批准红土创新纯债债券型证券投资基金设立的文件；

- (2) 红土创新纯债债券型证券投资基金基金合同；
- (3) 红土创新纯债债券型证券投资基金托管协议；
- (4) 红土创新纯债债券型证券投资基金招募说明书；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- (6) 报告期内红土创新纯债债券型证券投资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)

红土创新基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日