

# 红土创新货币市场基金 2023 年中期报告

2023 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	10
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.....	11
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>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 债券回购融资情况.....	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	39
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.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	40
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	41
7.8 期末按实际利率计算的账面价值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.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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情况.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	44
10.9 其他重大事件.....	45
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>46</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.....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新货币市场基金	
基金简称	红土创新货币	
基金主代码	004967	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 8 月 3 日	
基金管理人	红土创新基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	3, 424, 321, 936. 13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	红土创新货币 A	红土创新货币 B
下属分级基金的交 易代码	004967	004968
报告期末下属分级 基金的份额总额	32, 147, 937. 84 份	3, 392, 173, 998. 29 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，力争获得超越业绩比较基准的收益率。
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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	殷喆
	联系电话	0755-33011858
	电子邮箱	yinz@htcfund.com
客户服务电话	0755-33011866	95561
传真	0755-33011855	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	深圳市南山区海德三道 1066 号深	上海市浦东新区银城路 167 号 4

	创投广场 48 层	楼
邮政编码	518048	200120
法定代表人	阮菲	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.htcxfund.com
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	深圳市南山区海德三道 1066 号 深创投广场 48 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	红土创新货币 A	红土创新货币 B
本期已实现收 益	255,390.91	32,403,104.67
本期利润	255,390.91	32,403,104.67
本期净值收益 率	0.8235%	0.9439%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	期末基金资产 净值	32,147,937.84
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(2023 年 6 月 30 日)	
	累计净值收益 率	14.5823%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益, 由于货币市场基金采用摊余成本法核算, 因此, 公允价值变动收益为零, 本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2. 本基金收益分配为按日结转份额。

### 3.2 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	0.2007%	0.0070%	0.0298%	0.0000%	0.1709%	0.0070%
过去三个月	0.4037%	0.0048%	0.0903%	0.0000%	0.3134%	0.0048%
过去六个月	0.8235%	0.0054%	0.1795%	0.0000%	0.6440%	0.0054%
过去一年	1.4411%	0.0047%	0.3617%	0.0000%	1.0794%	0.0047%
过去三年	5.2559%	0.0041%	1.0814%	0.0000%	4.1745%	0.0041%
自基金合同生效起至今	14.5823%	0.0046%	2.1202%	0.0000%	12.4621%	0.0046%

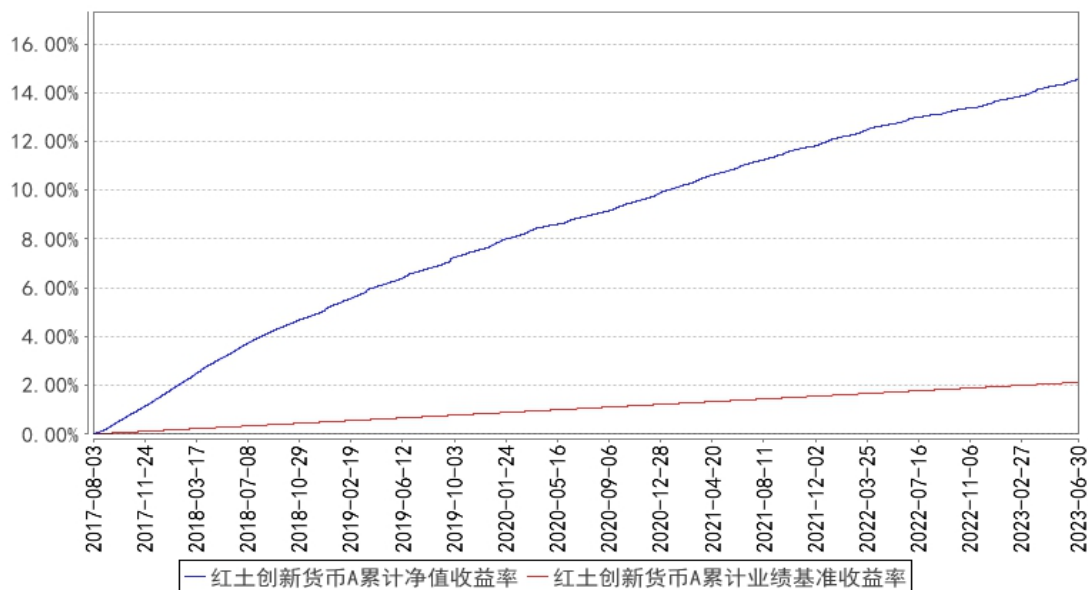
红土创新货币 B

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	0.2203%	0.0070%	0.0298%	0.0000%	0.1905%	0.0070%
过去三个月	0.4638%	0.0048%	0.0903%	0.0000%	0.3735%	0.0048%
过去六个月	0.9439%	0.0054%	0.1795%	0.0000%	0.7644%	0.0054%
过去一年	1.6849%	0.0047%	0.3617%	0.0000%	1.3232%	0.0047%

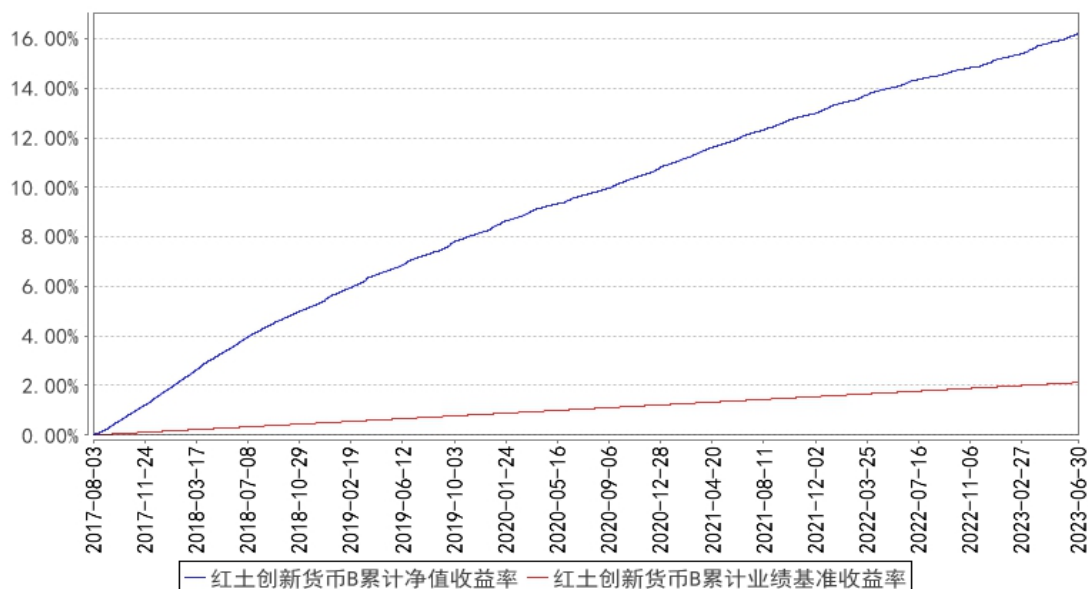
过去三年	6.0287%	0.0041%	1.0814%	0.0000%	4.9473%	0.0041%
自基金合同生效起至今	16.2316%	0.0046%	2.1202%	0.0000%	14.1114%	0.0046%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

红土创新货币A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



红土创新货币B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

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2023年6月30日，红土创新基金共管理22只公募基金，资产管理规模225.90亿元。

#### 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	2019年3月19日	-	13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、红土创新优淳货币市场基金、红土创新纯债债券型证券投资基金、红土创新丰源中短债债券型证券投资基金、红土创新丰泽中短债债券型证券投资基金、红土创新丰睿中短债债券型证券投资基金、红土创新中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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

无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《红土创新货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽

责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在不公平交易及异常交易的情况。

### 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，年初至春节，疫后复苏成为主线，基本面回暖下，1月信贷出现开门红，市场对经济增长预期较为充分，同时政策伴随经济复苏也进入观察期。春节后至3月，在未出现增量政策且“不大干快上”要求下，市场对增长预期出现下修，高频数据回落指向经济延续弱复苏。4月至6月，金融、经济数据环比走弱，显示经济修复节奏持续放缓，通胀弱势运行，市场对于“通缩”的担忧出现，需求不足成为核心矛盾。报告期内，政策面刺激力度有限，从财政政策来看，强刺激预期被不断证伪；从地产政策来看，因城施策的政策基调保持定力；从货币政策来看，央行通过降准、降息等方式保障流动性合理充裕。3月17日，央行降准25bp，释放中长期流动性；6月份，央行依次下调7天OMO利率、SLF利率、MLF利率和LPR，下调幅度均为10bp。

报告期内，经济修复从“强预期”转向“弱现实”，机构“钱多”的逻辑持续演绎，债牛的趋势逐渐确立，十年期国债收益率由年初的2.82%震荡下行至2.64%附近。1月份，经济强修复预期回升叠加资金面收紧，10年期国债收益率上行至2.93%附近。2至3月份，随着5%的政策目标落地，以及后续偏弱的进出口数据和通胀数据落地，债市情绪进一步好转，配置盘持续进场，10年期国债利率下行至2.85%附近。4月至6月份，基本面修复进程明显放缓，伴随大行信贷投放缩量，流动性环境更加宽松，“钱多”的逻辑继续演绎，收益率进入加速下行阶段，至6月末，10年期国债收益率收于2.64%附近。整体看，报告期内，1年期国债收益率下行24bp，1年期AAA同业存单收益率下行10bp，1年期AAA信用债收益率下行18bp，10年期国债收益率下行18bp。报告期内，由于资金面整体维持宽松，短期债券市场整体表现较好，我们在多数时间保持了较高的

组合杠杆，积极参与了信用债和存单的波段交易；在季末等关键资金时点，我们适当缩短了组合久期，增加了高流动性资产比例，并择机配置了部分收益率较高的存单和信用债资产。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期红土创新货币 A 的基金份额净值收益率为 0.8235%，同期业绩比较基准收益率为 0.1795%，本报告期红土创新货币 B 的基金份额净值收益率为 0.9439%，同期业绩比较基准收益率为 0.1795%。

#### 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，我们认为国内经济大概率边际改善，但在政策保持定力、相机抉择、未来发展重质不重量基调下，下半年国内经济或维持“稳复苏”的节奏。此外，海外衰退大逻辑不变的情况下，下半年我国出口所面临的外需逐步走弱的压力不容忽视。在经济复苏的初期，货币政策仍将呵护流动性保持合理充裕，资金利率难以明显收紧。中期看，经济逐步改善但斜率温和，资金面中枢回归但整体充裕，共同决定市场走势将继续维持震荡，交易性机会将持续阶段性存在。市场趋势性的变化，仍需等待关键变量的改变，比如经济修复的斜率、通胀、政策力度等。我们将积极跟踪生产、消费的修复进度，同时跟踪政策的变化和市场预期的变化，择机参与相对确定性更强的波段交易。

#### 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：255,390.91 元，向 B 级份额持有人分配利润：32,403,104.67 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：红土创新货币市场基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	573,589.64	4,778,458.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,642,476,133.75	3,006,597,001.90
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,642,476,133.75	3,006,597,001.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	777,215,595.83	1,474,625,005.67
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,506,370.03	537,271,370.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,426,771,689.25	5,023,271,836.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		495.29	-
应付管理人报酬		1,125,234.42	772,927.87
应付托管费		170,490.04	117,110.28
应付销售服务费		39,880.21	30,148.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		163,978.79	104,462.43
应付利润		713,784.16	577,319.42
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	235,890.21	327,606.49
负债合计		2,449,753.12	1,929,575.02
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	3,424,321,936.13	5,021,342,261.45
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		3,424,321,936.13	5,021,342,261.45
负债和净资产总计		3,426,771,689.25	5,023,271,836.47

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,424,321,936.13 份，其中红土创新货币 A 基金份额总额 32,147,937.84 份，基金份额净值 1.0000 元；红土创新货币 B 基金份额总额 3,392,173,998.29 份，基金份额净值 1.0000 元。

## 6.2 利润表

会计主体：红土创新货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		41,601,728.66	41,233,933.93
1. 利息收入		10,523,415.87	8,861,268.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,666.33	9,455.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		10,504,749.54	8,851,813.23
证券出借利息收 入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		31,078,312.79	32,372,665.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	31,078,312.79	32,372,665.35
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		8,943,233.08	9,629,290.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,628,459.06	5,263,655.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	852,796.79	797,523.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	207,801.23	274,945.19
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		2,073,136.38	3,108,740.96
其中：卖出回购金融资产支出		2,073,136.38	3,108,740.96
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		30,366.68	36,548.22
8. 其他费用	6.4.7.23	150,672.94	147,876.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,658,495.58	31,604,643.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,658,495.58	31,604,643.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		32,658,495.58	31,604,643.83

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：红土创新货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	5,021,342,261.45	-	-	5,021,342,261.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	5,021,342,261.45	-	-	5,021,342,261.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,597,020,325.32	-	-	-1,597,020,325.32
（一）、综合收益总额	-	-	32,658,495.58	32,658,495.58

(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-1,597,020,325.32	-	-	-1,597,020,325.32
其中：1. 基金申购款	11,145,765,765.31	-	-	11,145,765,765.31
2. 基金赎回款	-12,742,786,090.63	-	-	-12,742,786,090.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-32,658,495.58	-32,658,495.58
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	3,424,321,936.13	-	-	3,424,321,936.13
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	5,089,784,722.05	-	-	5,089,784,722.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-



其他	-	-	-	-
二、本 期初净 资产（基 金净 值）	5,089,784,722.05	-	-	5,089,784,722.05
三、本 期增 减变 动额 （减 少以 “-” 号 填 列）	-897,572,317.93	-	-	-897,572,317.93
（一）、 综合收 益总 额	-	-	31,604,643.83	31,604,643.83
（二）、 本 期基 金份 额交 易产 生的 基金 净值 变动 数 （净 值减 少以 “-” 号 填 列）	-897,572,317.93	-	-	-897,572,317.93
其中：1. 基金申 购款	8,812,087,670.62	-	-	8,812,087,670.62
2. 基金 赎回 款	-9,709,659,988.55	-	-	-9,709,659,988.55
（三）、 本 期向 基金 份额 持有 人分 配利 润产 生的 基金 净值 变动 （净 值减 少以 “-” 号 填 列）	-	-	-31,604,643.83	-31,604,643.83
（四）、 其 他综 合收 益结 转留 存收 益	-	-	-	-
四、本 期末 净资	4,192,212,404.12	-	-	4,192,212,404.12

产（基金净值）				
---------	--	--	--	--

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>冀洪涛</u>	<u>周厚桥</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]1181号《关于准予红土创新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3,570,575,086.61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761号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《红土创新货币市场基金基金合同》于2017年8月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,570,595,489.29份基金份额,其中认购资金利息折合20,402.68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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《红土创新货币市场基金基金合同》和《红土创新货币市场基金招募说明书》的规定,本基金根据基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额类别。基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量小于500万份且按照0.25%年费率计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量大于或等于500万份且按照0.01%年费率计提销售服务费的基金份额,称为B类基金份额。A类基金份额和B类基金份额单独设置基金代码,并分别公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

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(包括但不限于短期融资券、超短期融资券、中期票据)、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《红土创新货币市场基金基金合同》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。

## 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

除下述会计政策和会计估计外, 本基金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。

### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

#### 新金融工具准则

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

#### (1) 金融资产

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

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量:

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

## (2) 金融负债

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

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

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

## (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

## (2) 金融负债的分类

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

### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交

易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每日计提应计利息,同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

对于其他各类应收款项,无论是否存在重大融资成分,本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

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

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

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

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

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资于处置时,其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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

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

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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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

#### 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	573,589.64
等于：本金	568,654.77
加：应计利息	4,934.87
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	573,589.64

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)	
债券	交易所市场	—	—	—	
	银行间市场	2,642,476,133.75	2,643,305,515.76	829,382.01	0.0242
	合计	2,642,476,133.75	2,643,305,515.76	829,382.01	0.0242
资产支持证券	—	—	—	—	
合计	2,642,476,133.75	2,643,305,515.76	829,382.01	0.0242	

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

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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 2023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	777,215,595.83	-
合计	777,215,595.83	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.43
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	116,913.41
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付银行划款手续费	5,831.02
预提费用	113,138.35
合计	235,890.21

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

## 红土创新货币 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,220,652.20	48,220,652.20
本期申购	43,563,956.98	43,563,956.98
本期赎回（以“-”号填列）	-59,636,671.34	-59,636,671.34

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	32,147,937.84	32,147,937.84

## 红土创新货币 B

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,973,121,609.25	4,973,121,609.25
本期申购	11,102,201,808.33	11,102,201,808.33
本期赎回（以“-”号填列）	-12,683,149,419.29	-12,683,149,419.29
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	3,392,173,998.29	3,392,173,998.29

注：1. 申购含红利再投、级别调整入份额。赎回含级别调整出份额。

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

## 红土创新货币 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	255,390.91	-	255,390.91
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	-255,390.91	-	-255,390.91
本期末	-	-	-

## 红土创新货币 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	32,403,104.67	-	32,403,104.67
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	-32,403,104.67	-	-32,403,104.67
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	18,666.33
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	18,666.33

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	28,276,016.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,802,295.91
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	31,078,312.79

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,165,493,924.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,076,557,675.11
减：应计利息总额	86,133,953.56
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	2,802,295.91

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益****6.4.7.13 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.15 其他收入**

本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.16 信用减值损失****6.4.7.17 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	27,934.59
上清所证书使用费	600.00
上清所债券托管帐户维护费	9,000.00
银行间结算账户维护费	9,000.00
合计	150,672.94

**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、注册登记机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
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
深圳市创新投资集团有限公司（“深创	基金管理人的控股股东

投”)	
-----	--

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交易。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,628,459.06	5,263,655.33
其中：支付销售机构的客户维护费	440,938.93	261,820.81

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 0.33%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 X0.33%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	852,796.79	797,523.49

注：支付基金托管人兴业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 X0.05%/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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红土创新货币 A	红土创新货币 B	合计
红土创新基金	6,572.28	128,297.96	134,870.24
兴业银行	4,514.95	8.81	4,523.76

合计	11,087.23	128,306.77	139,394.00
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红土创新货币 A	红土创新货币 B	合计
	红土创新基金	3,901.12	133,857.22
兴业银行	4,328.73	16.98	4,345.71
合计	8,229.85	133,874.20	142,104.05

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

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	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
兴业银行	-	-	-	-	761,789.00 0.00	40,262.23
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	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
兴业银行	-	-	-	-	100,000.00 0.00	3,906.71

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	红土创新货币 A	红土创新货币 B
基金合同生效日（2017 年 8 月 3 日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	91,392,981.95

报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	20,000,000.00
报告期末持有的基金份额	0.00	71,392,981.95
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	2.10%
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	红土创新货币 A	红土创新货币 B
基金合同生效日（2017年8月3日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

#### 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

本报告期无各关联方投资本基金的情况。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
兴业银行	573,589.64	18,666.33	22,904,525.83	9,455.35

注：本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

红土创新货币 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
253,836.03	-	1,554.88	255,390.91	-
红土创新货币 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
32,268,194.81	-	134,909.86	32,403,104.67	-

#### 6.4.12 期末（2023 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

本基金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 2023 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 0 元。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 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。

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行兴业银行，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 AA+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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	30,399,341.86
A-1 以下	-	-
未评级	799,085,348.01	372,545,823.80
合计	799,085,348.01	402,945,165.66

注：未评级部分为国债、政策性金融债、同业存单和短期融资券。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

资产支持证券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,194,556,016.45	2,040,694,282.31
合计	1,194,556,016.45	2,040,694,282.31

注：同业存单信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	423,308,944.80	470,561,583.03
AAA 以下	-	-
未评级	225,525,824.49	92,395,970.90
合计	648,834,769.29	562,957,553.93

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

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%。

#### 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%。

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公司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。

#### 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 2023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	573,589.64	-	-	-	573,589.64
交易性金融资产	2,642,476,133.75	-	-	-	2,642,476,133.75
买入返售金融资产	777,215,595.83	-	-	-	777,215,595.83
应收申购款	-	-	-	6,506,370.03	6,506,370.03
资产总计	3,420,265,319.22	-	-	6,506,370.03	3,426,771,689.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	495.29	495.29
应付管理人报酬	-	-	-	1,125,234.42	1,125,234.42
应付托管费	-	-	-	170,490.04	170,490.04
应付销售服务费	-	-	-	39,880.21	39,880.21
应付利润	-	-	-	713,784.16	713,784.16
应交税费	-	-	-	163,978.79	163,978.79
其他负债	-	-	-	235,890.21	235,890.21
负债总计	-	-	-	2,449,753.12	2,449,753.12
利率敏感度缺口	3,420,265,319	-	-	-4,056,616.93	3,424,321,936.13

	.22			1	
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,778,458.90	-	-	-	4,778,458.90
交易性金融资产	3,006,597,001.90	-	-	-	3,006,597,001.90
买入返售金融资产	1,474,625,005.67	-	-	-	1,474,625,005.67
应收申购款	-	-	-	537,271,370.00	537,271,370.00
资产总计	4,486,000,466.47	-	-	537,271,370.00	5,023,271,836.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	772,927.87	772,927.87
应付托管费	-	-	-	117,110.28	117,110.28
应付销售服务费	-	-	-	30,148.53	30,148.53
应付利润	-	-	-	577,319.42	577,319.42
应交税费	-	-	-	104,462.43	104,462.43
其他负债	-	-	-	327,606.49	327,606.49
负债总计	-	-	-	1,929,575.02	1,929,575.02
利率敏感度缺口	4,486,000,466.47	-	-	535,341,794.98	5,021,342,261.45

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	1,350,086.62	1,448,704.28
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,348,642.07	-1,444,377.63

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 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	2,642,476,133.75	3,006,597,001.90
第三层次	-	-
合计	2,642,476,133.75	3,006,597,001.90

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	2,642,476,133.75	77.11
	其中：债券	2,642,476,133.75	77.11
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	777,215,595.83	22.68
	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	573,589.64	0.02
4	其他各项资产	6,506,370.03	0.19
5	合计	3,426,771,689.25	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	6.61	
	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

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	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	16

#### 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	各期限负债占基金资产
----	--------	------------	------------

		净值的比例 (%)	净值的比例 (%)
1	30 天以内	25.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	4.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	67.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	99.21	-

#### 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

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	387,171,928.82	11.31
	其中：政策性 金融债	294,644,169.72	8.60
4	企业债券	103,733,969.07	3.03
5	企业短期融 资券	576,910,673.73	16.85
6	中期票据	380,103,545.68	11.10
7	同业存单	1,194,556,016.45	34.88
8	其他	-	-
9	合计	2,642,476,133.75	77.17
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资 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)	按实际利率计算的 账面价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	112317140	23 光大银行 CD140	3,000,000	298,829,605.23	8.73
2	112303118	23 农业银行 CD118	2,000,000	199,168,442.32	5.82
3	112303127	23 农业银行 CD127	2,000,000	198,995,736.80	5.81
4	112305143	23 建设银行 CD143	2,000,000	198,979,040.65	5.81
5	101801068	18 浙能源 MTN003	1,000,000	104,034,290.57	3.04
6	072210203	22 国泰君安 CP003	1,000,000	101,533,667.96	2.97
7	102282117	22 大唐集 MTN007	1,000,000	101,279,223.19	2.96
8	042280440	22 北控集 CP003	1,000,000	101,260,283.47	2.96
9	012284428	22 南电 SCP017	1,000,000	101,171,312.49	2.95
10	112303116	23 农业银行 CD116	1,000,000	99,595,738.45	2.91

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1800%
报告期内偏离度的最低值	0.0188%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0908%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

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

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 期末按实际利率计算的账面价值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

#### 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 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。

##### 7.9.3 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	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	6,506,370.03
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,506,370.03

#### 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，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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（%）
红土创新货币 A	9,765	3,292.16	15,002,031.82	46.67	17,145,906.02	53.33
红土创新货币 B	3,545	956,889.70	3,342,512,153.62	98.54	49,661,844.67	1.46
合计	13,192	259,575.65	3,357,514,185.44	98.05	66,807,750.69	1.95

注：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）。户均持有的基金份额的合计数=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	机构	1,865,672,958.37	54.48
2	机构	601,196,349.98	17.56
3	机构	500,621,348.10	14.62
4	机构	100,002,800.57	2.92
5	产品	51,336,673.76	1.50
6	机构	23,737,785.80	0.69
7	产品	21,175,710.67	0.62
8	产品	20,018,489.29	0.58
9	机构	16,558,215.96	0.48

10	产品	15,452,338.83	0.45
----	----	---------------	------

### 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	红土创新货币 A	4,754.42	0.01
	红土创新货币 B	6,316,879.40	0.19
	合计	6,321,633.82	0.18

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	红土创新货币 A	0
	红土创新货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	红土创新货币 A	0
	红土创新货币 B	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红土创新货币 A	红土创新货币 B
基金合同生效日 (2017年8月3日) 基金份额总额	8,075,169.29	3,562,520,320.00
本报告期期初基金份额总额	48,220,652.20	4,973,121,609.25
本报告期基金总申购份额	43,563,956.98	11,102,201,808.33
减：本报告期基金总赎回份额	59,636,671.34	12,683,149,419.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	32,147,937.84	3,392,173,998.29

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：自 2023 年 4 月 11 日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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

注：本基金本报告期无租用证券公司交易单元的有关情况。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## 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	红土创新货币市场基金 2023 年春节假期前的申购提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 1 月 17 日
2	红土创新基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在北京雪球基金销售有限公司申购起点金额的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 3 月 21 日
3	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 21 日
4	红土创新货币市场基金 2023 年劳动节假期前的申购提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 26 日
5	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 4 月 27 日
6	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 10 日
7	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金在国信证券暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 5 月 25 日
8	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金财富为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 2 日
9	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新兰德为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 14 日
10	红土创新货币市场基金 2023 年端午节假期前的申购提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 19 日
11	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国泰君安为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 19 日
12	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长江证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 26 日
13	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 27 日
14	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华泰期货为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2023 年 6 月 29 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	20230101-20230630	1,899,170,819.39	816,502,138.98	850,000,000.00	1,865,672,958.37	54.48
产品特有风险							
<p>1. 巨额赎回风险</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>2. 转换运作方式或终止基金合同的风险</p> <p>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;</p> <p>3. 流动性风险</p> <p>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。</p>							

### 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货币市场基金募集的文件;
- (2) 《红土创新货币市场基金基金合同》;
- (3) 《红土创新货币市场基金托管协议》;
- (4) 《红土创新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

基金管理人、基金托管人处

## 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

2023 年 8 月 31 日