

红土创新货币市场基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 23 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。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	7,202,498,152.50 份	
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	20,418,534.30 份	7,182,079,618.20 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，把风险控制在预算之内，在不增加风险的基础上保持高流动性，最终追求稳定的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		红土创新基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张洗尘	曾麓燕
	联系电话	0755-33011878	021-52629999-212040
	电子邮箱	zhangxc@htcfund.com	015292@cib.com.cn
客户服务电话		0755-33011866	95561
传真		0755-33011855	021-62535823

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htcfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年		2017 年 8 月 3 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	红土创新货币 A	红土创新货币 B	红土创新货币 A	红土创新货币 B
本期已实现 收益	1,172,531.28	291,609,077.64	429,242.58	38,314,158.67
本期利润	1,172,531.28	291,609,077.64	429,242.58	38,314,158.67
本期净值收 益率	3.5714%	3.8221%	1.5643%	1.6630%
3.1.2 期末 数据和指标	2018 年末		2017 年末	
期末基金资 产净值	20,418,534.30	7,182,079,618.20	177,223,203.58	2,936,982,382.28
期末基金份 额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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

2. 本基金收益分配为按日结转份额。

3. 本基金合同生效日为 2017 年 8 月 3 日, 基金合同生效日至本报告期末, 本基金运作时间未满一年。

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

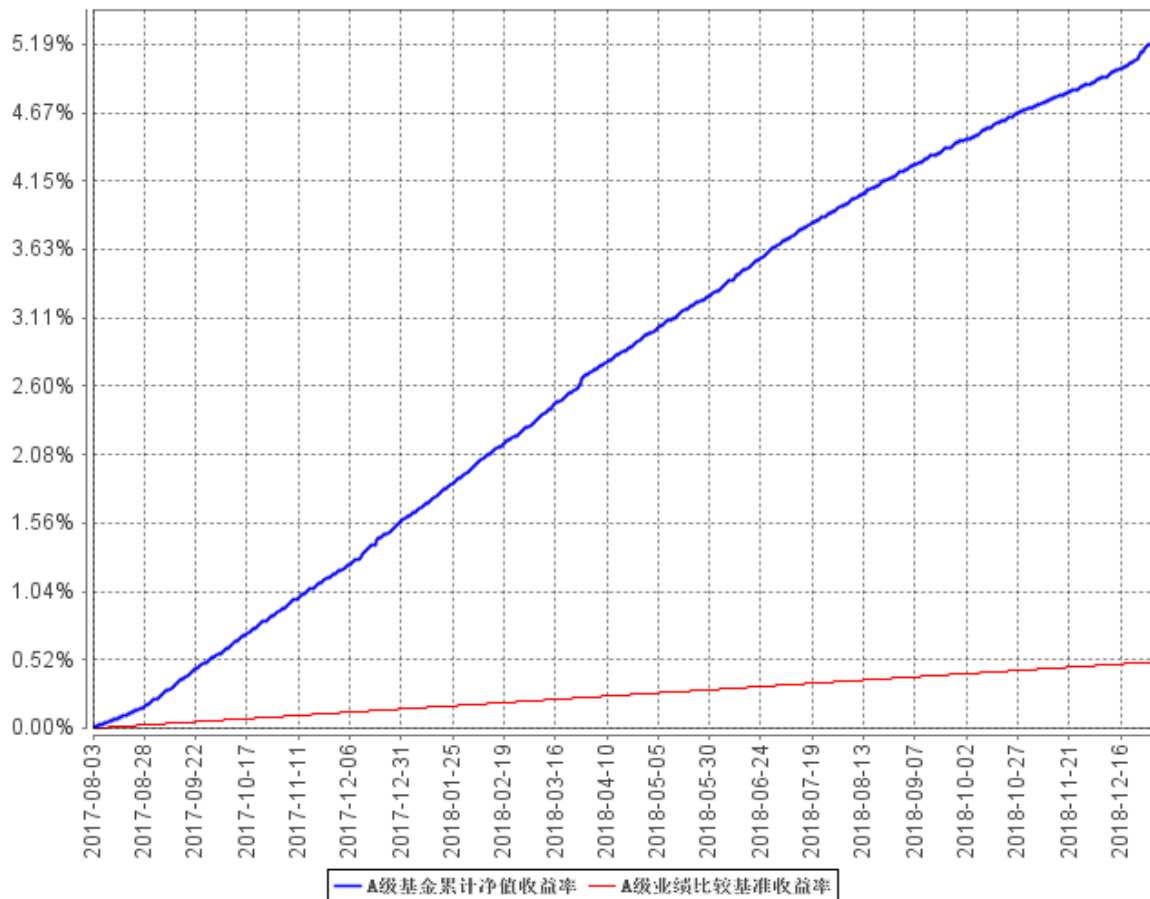
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7024%	0.0047%	0.0899%	0.0000%	0.6125%	0.0047%
过去六个月	1.4955%	0.0039%	0.1796%	0.0000%	1.3159%	0.0039%
过去一年	3.5714%	0.0040%	0.3560%	0.0000%	3.2154%	0.0040%
自基金合同 生效起至今	5.1916%	0.0038%	0.5029%	0.0000%	4.6887%	0.0038%

红土创新货币 B

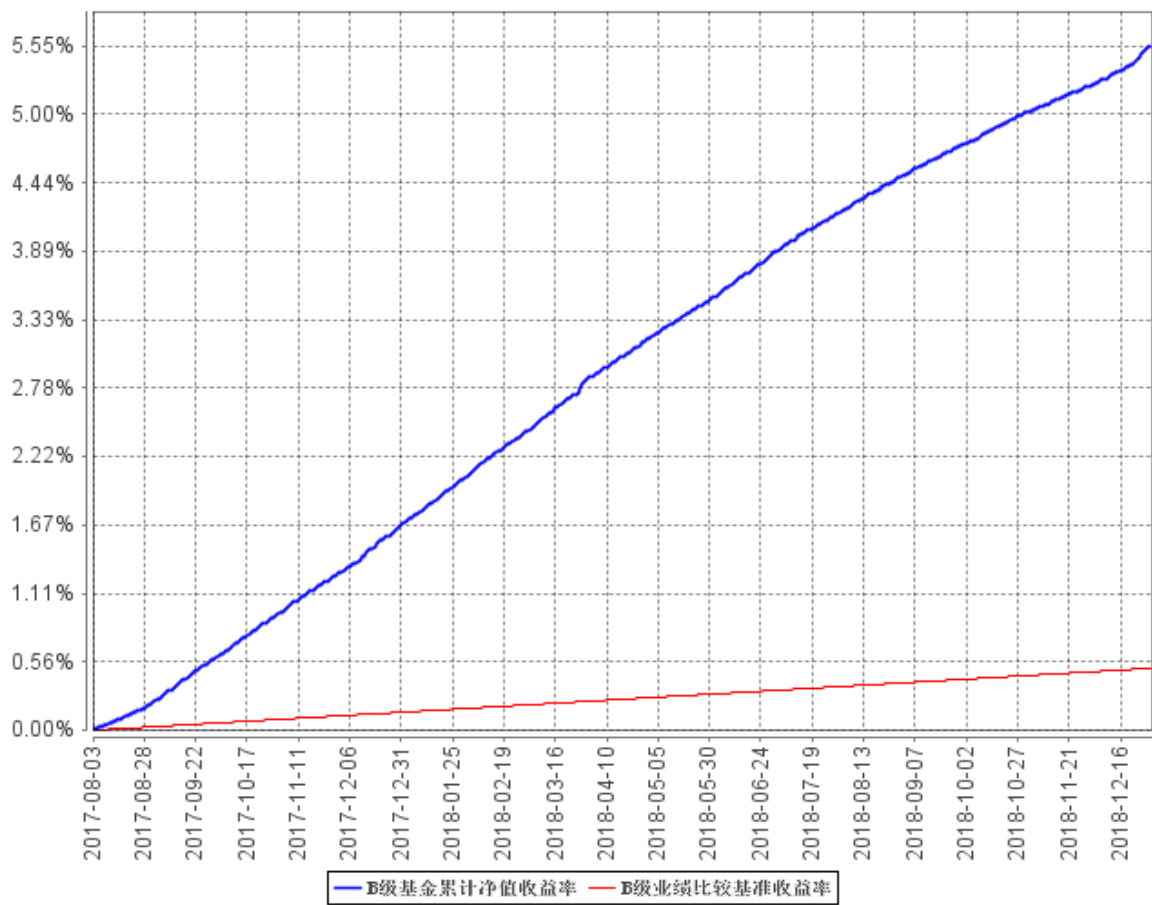
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7635%	0.0047%	0.0899%	0.0000%	0.6736%	0.0047%
过去六个月	1.6187%	0.0039%	0.1796%	0.0000%	1.4391%	0.0039%
过去一年	3.8221%	0.0040%	0.3560%	0.0000%	3.4661%	0.0040%
自基金合同 生效起至今	5.5487%	0.0038%	0.5029%	0.0000%	5.0458%	0.0038%

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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

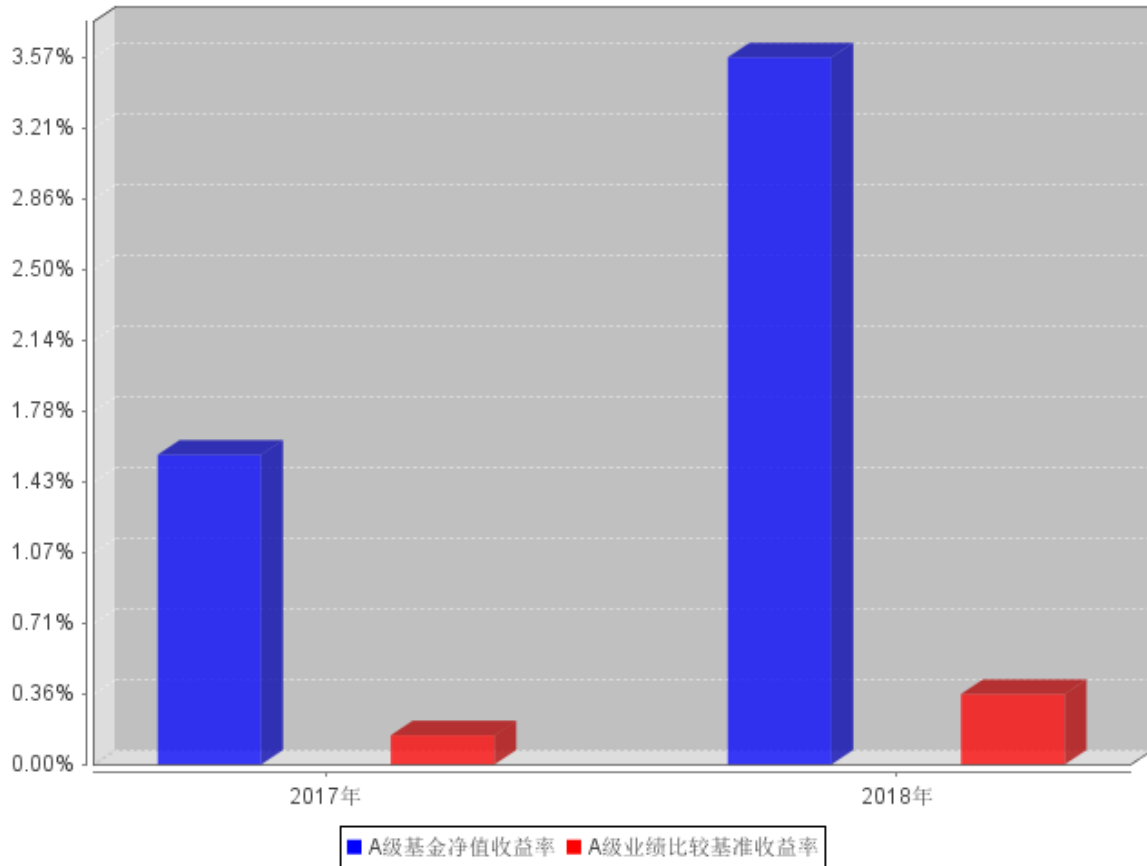


B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

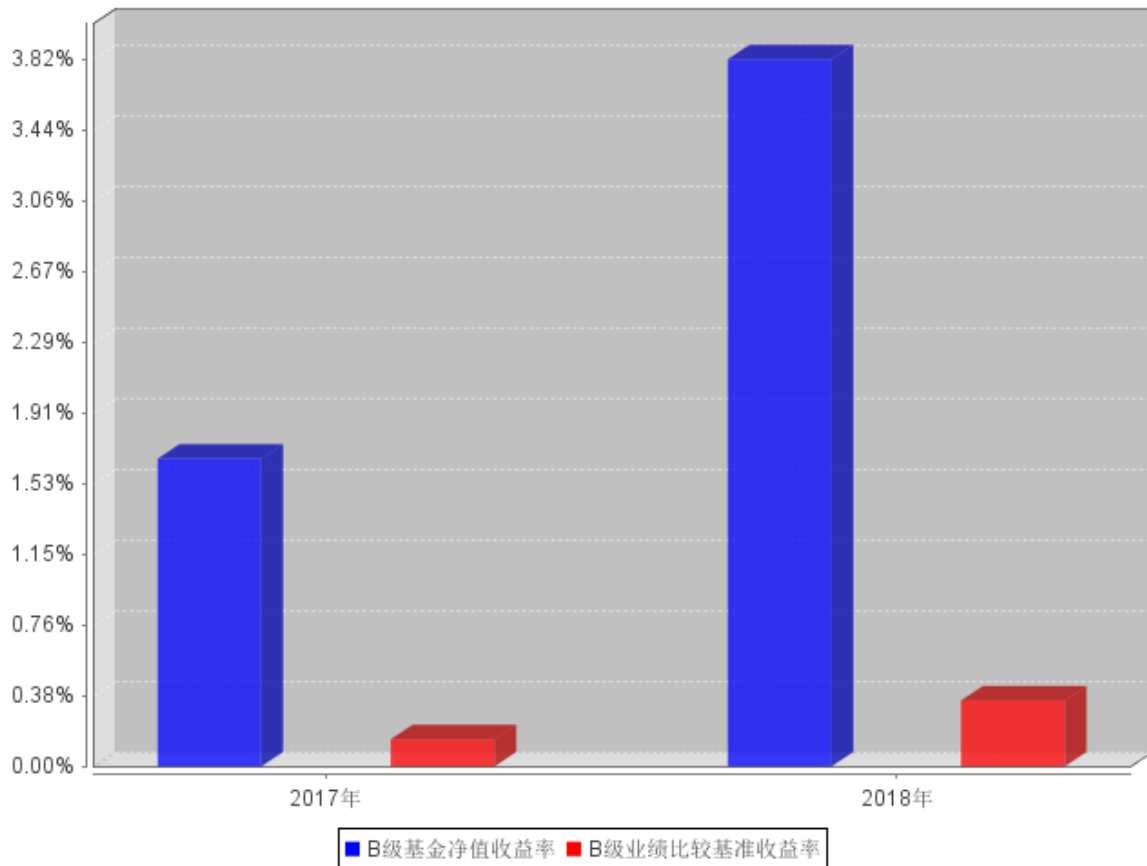


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：基金合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

红土创新货币 A					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2018	1,234,070.45	-	-61,539.17	1,172,531.28	
2017	357,650.87	-	71,591.71	429,242.58	
合计	1,591,721.32	-	10,052.54	1,601,773.86	

单位：人民币元

红土创新货币 B					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2018	289,134,562.19	-	2,474,515.45	291,609,077.64	

2017	37,070,086.07	-	1,244,072.60	38,314,158.67	
合计	326,204,648.26	-	3,718,588.05	329,923,236.31	

§ 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 1.5 亿元人民币，是国内首家创投系公募基金管理公司。公司股东为深圳市创新投资集团有限公司，持有股权 100%。

红土创新基金在公募基金业务的优良传承基础上，借力股东对创业投资行业的深入理解，外加国内独创的博士后工作站研究支持，充分利用一级市场优势向二级市场延伸，将红土创新基金打造成为以权益类投资为特色的创新型资产管理机构。截至 2018 年 12 月 31 日，红土创新基金共管理 7 只公募基金，资产管理规模 81.96 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8月3日	-	10	厦门大学金融学学士。十年公募基金从业经验，历任宝盈基金营销策划经理、高级交易员。现担任红土创新货币市场基金、红土创新优渥货币市场基金、红土创新增强收益债券型基金基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内经济面临的内外部挑战逐步加剧，伴随金融去杠杆的不断推进，影子银行规模持续收缩，地方政府债务监管日趋严格，城投公司融资多方受限，基础设施投资增速出现了明显下滑，对投资需求整体形成拖累；居民部门杠杆过去几年累计速度较快，对消费的抑制作用已经开始显现；中美贸易冲突朝着长期化复杂化的势头发展，计划对中国出口商品加征关税对应的规模逐步提高，外贸行业抢出口效应明显，市场悲观情绪加剧。2018 年大部分时点宏观政策体现

为“宽货币”和“紧信用”的组合，资金价格中枢相比 2017 年明显回落，债券市场出现一轮大的趋势性行情。2018 年 12 月召开的中央经济工作会议强调“宏观政策要强化逆周期调节，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，适时预调微调，稳定总需求”。逆周期的宏观调控政策持续出台，“紧信用”环境向“宽信用”在逐步过渡，开始不断修复市场对于未来经济的悲观预期。

报告期内银行间市场流动性保持宽松，资金价格持续处于低位，存款类机构 7 天质押式回购利率（DR007）在期间内由 2017 年下半年 2.9% 的中枢下行至 2018 年下半年 2.6% 的中枢，同时资金市场的波动率明显降低。本基金全年保持了适中的杠杆水平和合理的组合久期，并根据市场情况适时参与债券和同业存单的波段机会，在部分资金相对紧张的时点选择收益率较高的货币市场工具进行投资配置。

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 3.5714%，本报告期红土创新货币 B 的基金份额净值收益率为 3.8221%，同期业绩比较基准收益率为 0.3560%。

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 2019 年，我们认为全球经济面临共振式下行的压力，从中国自身来看，经济面临的困难在增加，外部环境和内部动能都面临一些挑战，“去杠杆”的政策取正向“稳杠杆”转变，但高企的债务率需要一定时间去消化，我们目前正处于经济增长的旧动能在逐步减弱，而新动能尚未达到能够支撑过往经济增速的条件，因此名义经济增长中枢的下移确定性很高。但是，我们预期逆周期的宏观调控政策将会继续加速出台，稳健的货币政策有望维持宽松力度，财政政策将会更加积极，金融监管与地产政策均有一定的结构性调整空间，经济有望在年内实现弱势企稳。本基金将继续维持适度的杠杆和合理的久期水平，积极把握债券一二级市场投资机会，提升组合收益水平。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工

的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 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：429,242.58 元，向 B 级份额持有人分配利润：38,314,158.67 元。

4.9 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

本报告期内，兴业银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对红土创新货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：429242.58 元，向 B 级份额持有人分配利润：38314158.67 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容,可通过登载于红土创新基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：红土创新货币市场基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	593,031.51	3,371,814.41
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	5,858,278,624.86	2,627,950,883.08
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	5,858,278,624.86	2,627,950,883.08
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,641,197,841.79	721,148,921.72
应收证券清算款	-	-
应收利息	34,184,093.74	14,434,408.41
应收股利	-	-
应收申购款	3,900,214.63	15,730.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,538,153,806.53	3,366,921,757.63
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,326,997,009.50	249,999,555.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,637,127.85	801,379.97
应付托管费	399,564.84	121,421.18
应付销售服务费	83,974.46	40,361.32
应付交易费用	367,684.93	136,077.10
应交税费	369,388.47	-

应付利息	850,884.56	174,991.29
应付利润	3,728,640.59	1,315,664.31
递延所得税负债	-	-
其他负债	221,378.83	126,721.60
负债合计	1,335,655,654.03	252,716,171.77
所有者权益：		
实收基金	7,202,498,152.50	3,114,205,585.86
未分配利润	-	-
所有者权益合计	7,202,498,152.50	3,114,205,585.86
负债和所有者权益总计	8,538,153,806.53	3,366,921,757.63

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 7,202,498,152.50 份，其中红土创新货币市场基金 A 类基金份额 20,418,534.30 份，红土创新货币市场基金 B 类基金份额 7,182,079,618.20 份。

7.2 利润表

会计主体：红土创新货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 8 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	352,493,658.28	46,763,513.23
1.利息收入	311,097,715.99	46,575,444.01
其中：存款利息收入	2,152,429.60	2,789,674.59
债券利息收入	262,199,354.02	41,914,804.79
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	46,745,932.37	1,870,964.63
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	41,395,942.29	188,069.22
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	41,395,942.29	188,069.22
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-

减：二、费用	59,712,049.36	8,020,111.98
1. 管理人报酬	27,621,963.92	3,120,291.77
2. 托管费	4,185,146.07	472,771.46
3. 销售服务费	914,314.20	117,899.44
4. 交易费用	2,452.30	-
5. 利息支出	26,502,120.85	4,155,866.06
其中：卖出回购金融资产支出	26,502,120.85	4,155,866.06
6. 税金及附加	152,808.12	-
7. 其他费用	333,243.90	153,283.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	292,781,608.92	38,743,401.25
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	292,781,608.92	38,743,401.25

7.3 所有者权益（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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	3,114,205,585.86	-	3,114,205,585.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	292,781,608.92	292,781,608.92
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）	4,088,292,566.64	-	4,088,292,566.64
其中：1. 基金申购款	42,366,151,829.98	-	42,366,151,829.98
2. 基金赎回款	-38,277,859,263.34	-	-38,277,859,263.34
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）	-	-292,781,608.92	-292,781,608.92
五、期末所有者权益（基金净值）	7,202,498,152.50	-	7,202,498,152.50
项目	上年度可比期间 2017 年 8 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 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）	3,570,595,489.29	-	3,570,595,489.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,743,401.25	38,743,401.25
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）	-456,389,903.43	-	-456,389,903.43
其中：1. 基金申购款	6,242,758,220.57	-	6,242,758,220.57
2. 基金赎回款	-6,699,148,124.00	-	-6,699,148,124.00
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）	-	-38,743,401.25	-38,743,401.25
五、期末所有者权益（基金净值）	3,114,205,585.86	-	3,114,205,585.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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 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；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人红土创新基金管理有限公司于 2019 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 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 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2017 年 8 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。对于取得债券投资支付的价款中包含的债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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合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，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

不适用。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每日以红利再投资方式支付收益。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

(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。

7.4.7 关联方关系

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
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

—

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 8 月 3 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	27,621,963.92	3,120,291.77
其中：支付销售机构的客户维护费	288,425.87	20,127.17

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 X 0.33% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 8 月 3 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,185,146.07	472,771.46

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 X 0.05% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	25,416.76	816,923.06	842,339.82
兴业银行	4,585.65	-	4,585.65
合计	30,002.41	816,923.06	846,925.47
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 8 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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	8,006.21	92,456.45	100,462.66
兴业银行	618.04	-	618.04
合计	8,624.25	92,456.45	101,080.70

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额和 B 类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给红土创新，再由红土创新计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 A/B 类基金资产净值 X 约定年费率/ 当年天数。

7.4.8.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	359,407,698.56	100,105,950.68	-	-	499,460,000.00	182,402.29
上年度可比期间 2017 年 8 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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	159,939,027.16	99,018,276.92	-	-	207,900,000.00	20,809.16

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 8 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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	593,031.51	962,771.35	3,371,814.41	1,091,896.81

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，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有 2,000,000 张 18 兴业银行 CD616，估值总额为人民币 198,444,378.89 元，占基金资产净值的比例为 2.75%；持有 700,000 张 18 兴业银行 CD219，估值

总额为人民币 69,694,270.86 元,占基金资产净值的比例为 0.97%(2017 年 12 月 31 日:2,000,000 张 17 兴业银行 CD677,估值总额为人民币 195,111,141.40 元,占基金资产净值的比例为 6.27%; 1,000,000 张 17 兴业银行 CD683,估值总额为人民币 98,767,453.82,占基金资产净值的比例为 3.17%)。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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 1,326,997,009.50 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
120207	12 国开 07	2019 年 1 月 3 日	100.17	1,200,000	120,199,157.65
111883835	18 盛京银行 CD374	2019 年 1 月 4 日	99.37	350,000	34,780,253.03
111880174	18 贵阳银行 CD117	2019 年 1 月 4 日	99.23	1,000,000	99,229,482.19
111886029	18 贵阳银行 CD162	2019 年 1 月 4 日	99.25	800,000	79,399,980.32
111872489	18 宁波银行 CD257	2019 年 1 月 3 日	99.21	4,120,000	408,749,213.32
111810616	18 兴业银行 CD616	2019 年 1 月 4 日	99.22	2,000,000	198,444,378.89
111872198	18 郑州银行 CD189	2019 年 1 月 4 日	99.25	2,000,000	198,498,009.88
111886232	18 徽商银行 CD150	2019 年 1 月 4 日	99.22	1,000,000	99,220,526.03
111886156	18 徽商银行 CD145	2019 年 1 月 4 日	99.18	1,000,000	99,182,977.59
合计				13,470,000	1,337,703,978.90

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- (1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 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 5,858,278,624.86 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 2,627,950,883.08 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	5,858,278,624.86	68.61
	其中: 债券	5,858,278,624.86	68.61
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,641,197,841.79	30.93
	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	593,031.51	0.01
4	其他各项资产	38,084,308.37	0.45
5	合计	8,538,153,806.53	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	11.80	
	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	1,326,997,009.50	18.42
	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	56

报告期内投资组合平均剩余期限最高值	68
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

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。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	38.21	18.42
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	7.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	68.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.71	-
	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		118.02	18.42

8.4 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。

8.5 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	199,087,395.85	2.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,411,078.59	3.20
	其中：政策性金融债	230,411,078.59	3.20
4	企业债券	30,262,760.43	0.42
5	企业短期融资券	777,432,181.15	10.79

6	中期票据	423,077,043.36	5.87
7	同业存单	4,198,008,165.48	58.29
8	其他	-	-
9	合计	5,858,278,624.86	81.34
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	111809289	18 浦发银行 CD289	6,500,000	645,047,136.50	8.96
2	111872489	18 宁波银行 CD257	5,000,000	496,054,870.54	6.89
3	111806216	18 交通银行 CD216	3,500,000	347,391,454.90	4.82
4	189956	18 贴现国债 56	2,000,000	199,087,395.85	2.76
5	111898775	18 哈尔滨银行 CD101	2,000,000	198,787,069.58	2.76
6	111872198	18 郑州银行 CD189	2,000,000	198,498,009.88	2.76
7	111810616	18 兴业银行 CD616	2,000,000	198,444,378.89	2.76
8	120207	12 国开 07	1,800,000	180,298,736.47	2.50
9	111899631	18 青岛银行 CD063	1,800,000	178,741,161.67	2.48
10	111886051	18 江西银行 CD103	1,800,000	178,641,760.35	2.48

8.7 “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	3
报告期内偏离度的最高值	0.2729%
报告期内偏离度的最低值	-0.0210%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0995%

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%。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	34,184,093.74
4	应收申购款	3,900,214.63
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	38,084,308.37

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	1,037	19,690.00	7,312,002.06	35.81%	13,106,532.24	64.19%
红 土 创 新 货 币 B	31	231,679,987.68	7,177,027,907.69	99.93%	5,051,710.51	0.07%
合计	1,068	6,743,912.13	7,184,339,909.75	99.75%	18,158,242.75	0.25%

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。

9.2 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	1,516,572,469.29	21.06%
2	银行类机构	1,515,708,376.09	21.04%
3	其他机构	885,020,798.97	12.29%
4	基金类机构	748,460,474.95	10.39%
5	其他机构	508,978,992.80	7.07%
6	基金类机构	361,272,869.60	5.02%
7	其他机构	283,305,224.99	3.93%
8	基金类机构	204,521,361.26	2.84%
9	券商类机构	200,000,000.00	2.78%
10	其他	155,849,305.53	2.16%

9.3 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	50,543.51	0.0007%
	红土创新货币 B	0.00	0.0000%
	合计	50,543.51	0.0007%

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。

9.4 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	红土创新货币 A	0~10
	红土创新货币 B	0
	合计	0~10
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

注：本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	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	177,223,203.58	2,936,982,382.28
本报告期期间基金总申购份额	67,040,068.42	42,299,111,761.56
减:本报告期期间基金总赎回份额	223,844,737.70	38,054,014,525.64
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,418,534.30	7,182,079,618.20

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 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。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 130,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

本基金本报告期无租用证券公司交易单元的有关情况。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20180102-20180104	504,385,103.67	1,530,635,695.30	1,150,000,000.00	885,020,798.97	12.29%
	2	20180328-20180402	504,385,103.67	1,530,635,695.30	1,150,000,000.00	885,020,798.97	12.29%
	3	20180105-20180327	0.00	5,522,945,615.64	5,522,945,615.64	0.00	0.00%
	4	20180403-20180426	0.00	5,522,945,615.64	5,522,945,615.64	0.00	0.00%
	5	20180328-20180402	300,064,288.78	507,445,847.64	690,000,000.00	117,510,136.42	1.63%
	6	20180417-20180712	0.00	2,181,941,712.02	2,181,941,712.02	0.00	0.00%
	7	20181226-20181231	0.00	1,516,572,469.29	0.00	1,516,572,469.29	21.06%
	8	20181226-20181231	0.00	1,515,708,376.09	0.00	1,515,708,376.09	21.04%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金存在单一投资者所持有的基金份额占比达到或超过 20%的情况，在特定赎回比例以及市场条件下，可能导致基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。