

红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
期证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	30
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	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	31
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	31

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.....	31
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.....	32
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.....	32
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	32
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	32
7.12 投资组合报告附注.....	32
§ 8 基金份额持有人信息.....	33
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	33
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	33
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.....	33
§ 9 开放式基金份额变动.....	33
§ 10 重大事件揭示.....	33
10.1 基金份额持有人大会决议.....	33
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.....	33
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	33
10.4 基金投资策略的改变.....	34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	34
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.....	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	34
10.8 其他重大事件.....	35
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	36
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.....	36
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	37
§ 12 备查文件目录.....	37
12.1 备查文件目录.....	37
12.2 存放地点.....	37
12.3 查阅方式.....	37

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
基金简称	红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
基金主代码	018219
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 5 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	277,308,076.16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用抽样复制和动态最优化的方法，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的同业存单，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。 1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	红土创新基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王小飞
	联系电话	0755-33011858
	电子邮箱	yinz@htcfund.com
客户服务电话	0755-33011866	021-60637228
传真	0755-33011855	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 48 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	阮菲	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.htcfund.com
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,960,713.53
本期利润	4,967,338.82
加权平均基金份额本期利润	0.0117
本期加权平均净值利润率	1.15%
本期基金份额净值增长率	1.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,011,501.55
期末可供分配基金份额利润	0.0217
期末基金资产净值	283,398,898.56
期末基金份额净值	1.0220
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.20%

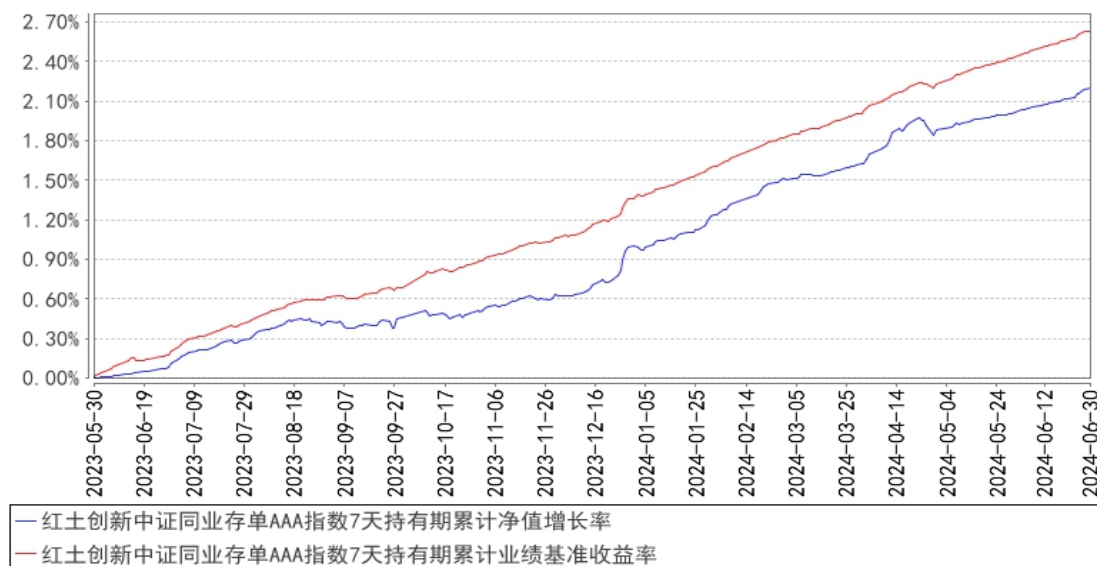
3.2 基金净值表现

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

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	0.18%	0.01%	0.19%	0.01%	-0.01%	0.00%
过去三个月	0.56%	0.02%	0.62%	0.01%	-0.06%	0.01%
过去六个月	1.19%	0.02%	1.25%	0.01%	-0.06%	0.01%
过去一年	2.09%	0.02%	2.42%	0.01%	-0.33%	0.01%
自基金合同生效起至今	2.20%	0.02%	2.63%	0.01%	-0.43%	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

红土创新中证同业存单AAA指数7天持有期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2024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174.64亿元。

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	2023年5	-	14年	厦门大学金融工程硕士，CPA，CFA。曾任

	基金经理	月 30 日			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、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、红土创新丰和利率债债券型证券投资基金。
--	------	--------	--	--	---

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、《红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金》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，国内经济延续弱修复。上半年在挤水分、调结构、禁止“手工补息”等各因素影响下，金融数据多弱于预期，基本面尚未全面回暖。报告期内，政策面整体以稳为主。货币政策方面，央行维持流动性合理充裕的基调没有改变，1 月 24 日，央行宣布自 2 月 5 号下调存款

准备金率 0.5 个百分点，1 月 25 日下调支农支小再贷款、再贴现利率 0.25 个百分点。政策层继续强调“保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定，综合施策、校正背离、稳定预期，坚决对顺周期行为予以纠偏，防止形成单边一致性预期并自我强化，坚决防范汇率超调风险”，稳定汇率需求依然排在较高顺位。财政政策方面，强调要强化宏观政策逆周期调节，新亮点主要体现在万亿规模的“超长期特别国债”。4 月底政治局会议提出要及早发行并用好超长期特别国债，加快专项债发行使用进度，保持必要的财政支出强度。除加快发债之外，财税政策支持推动大规模设备更新和消费品以旧换新，也是重点所在。地产方面，年初多地限购政策放松、房企项目白名单、2 月 LPR 非对称调降等，政策加码房地产供需两端，释放出强烈稳地产信号。4 月底政治局会议提出“统筹研究消化存量房产和优化增量住房的政策措施”，消化存量、优化增量成为未来房地产调控的主要方向。6 月 7 日国常会再提“去库存”，表明“去库存”工作成为楼市短期首要任务。同时，央行、住建部会议多次明确收购已建成存量商品房用作保障性住房。通过收购去库存加快存量商品房销售，加大保障性住房供给，推动构建房地产“市场与保障”双轮驱动发展的新模式。

报告期内，机构行为主导债市行情，机构“钱多”与政府债券供给偏慢的环境下“资产荒”极致演绎。债市表现强势，收益率总体走低，期限利差收缩。1 季度资金面保持宽松，基本面数据相对较弱，在“资产荒”机构持续增配背景下，长、短端利率均下行，长端向下突破 2.3% 阻力位。4 月开始央行反复提及长债风险，引发收益率上行，10Y 国债收益率一度反弹至 2.35%，30Y 国债收益率反弹至 2.58%。进入 5 月后，在基本面仍然偏弱、特别国债供给节奏偏缓等影响下，债市情绪逐步好转，呈现震荡下行态势，中短端下行幅度较大。长债和超长债下行至央行前期提醒的关键点位，短暂的利空如跨季资金面收敛、LPR 不降等，未能干扰市场做多情绪。整体看，报告期内，1 年期国债收益率下行约 57bp，1 年期 AAA 同业存单收益率下行约 48bp，1 年期 AAA 信用债收益率下行约 50bp，10 年期国债收益率下行约 35bp。报告期内，本基金主要投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券。另外，紧密跟踪市场变化，挖掘投资范围内不同资产的投资价值，择优配置。同时，在跟踪误差可控的前提下，严控信用风险，保持组合流动性，增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0220 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.19%，业绩比较基准收益率为 1.25%。

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延续回升向好态势。重点关注稳地产政策持续发力后，

房地产市场能否企稳。其次，关注三季度地方专项债发行进度以及是否能形成实物工作量。海外方面，贸易摩擦和地缘政治风险不断显现，需求和补库存推动的出口高增持续性仍然存疑。在经济稳复苏阶段，货币政策预计仍将呵护流动性保持合理充裕，短期央行依旧强调“灵活运用利率、存款准备金率等政策工具”，同时，海外主要经济体陆续进入降息周期，为我国后续货币政策打开空间。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。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，择机参与同业存单波段交易。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

无。

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，中国建设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，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	136,941.36	786,554.11
结算备付金		-	-
存出保证金		10,212.99	35,468.02
交易性金融资产	6.4.7.2	338,747,466.01	1,185,211,458.37
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		338,747,466.01	1,185,211,458.37
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	-	-
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		10,000,000.00	239,974,052.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		348,894,620.36	1,426,007,533.11
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		65,214,717.26	249,849,081.94
应付清算款		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		47,434.89	140,711.23
应付托管费		11,858.76	35,177.80
应付销售服务费		47,434.89	140,711.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,765.14	3,289.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	169,510.86	265,162.41
负债合计		65,495,721.80	250,434,134.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	277,308,076.16	1,163,977,345.35
未分配利润	6.4.7.12	6,090,822.40	11,596,053.35
净资产合计		283,398,898.56	1,175,573,398.70
负债和净资产总计		348,894,620.36	1,426,007,533.11

注：本基金合同生效日为 2023 年 05 月 30 日，本报告期自基金合同生效日 2023 年 05 月 30 日起至 2024 年 06 月 30 日止。报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0220 元，基金份额总额 277,308,076.16 份。

6.2 利润表

会计主体：红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 5 月 30 日（基金合 同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,028,432.10	10,477,245.09
1. 利息收入		1,187.74	5,745,059.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,187.74	2,047,794.10
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		-	3,697,265.09
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		8,020,619.07	3,533,029.36
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	8,020,619.07	3,533,029.36
资产支持证券投	6.4.7.16	-	-

资收益			
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	-	-
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	-993,374.71	1,131,900.00
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	-	67,256.54
减：二、营业总支出		2,061,093.28	2,676,469.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	429,896.42	1,175,505.99
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	107,474.14	293,876.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	429,896.42	1,175,505.99
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		961,455.06	-
其中：卖出回购金融资产支出		961,455.06	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		3,645.03	-
8. 其他费用	6.4.7.23	128,726.21	31,581.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,967,338.82	7,800,775.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,967,338.82	7,800,775.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,967,338.82	7,800,775.50

6.3 净资产变动表

会计主体：红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,163,977,345.35	-	11,596,053.35	1,175,573,398.70
二、本期期初净	1,163,977,345.	-	11,596,053.35	1,175,573,398.7

资产	35			0
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-886,669,269.19	-	-5,505,230.95	-892,174,500.14
(一)、综合收益总额	-	-	4,967,338.82	4,967,338.82
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-886,669,269.19	-	-10,472,569.77	-897,141,838.96
其中：1. 基金申购款	43,757,928.00	-	800,963.81	44,558,891.81
2. 基金赎回款	-930,427,197.19	-	-11,273,533.58	-941,700,730.77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	277,308,076.16	-	6,090,822.40	283,398,898.56
项目	上年度可比期间			
	2023 年 5 月 30 日(基金合同生效日)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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,917,815,516.85	-	-	6,917,815,516.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	7,800,775.50	7,800,775.50
(一)、综合收益总额	-	-	7,800,775.50	7,800,775.50
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-

2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,917,815,516.85	-	7,800,775.50	6,925,616,292.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至-财务报表由下列负责人签署：

冀洪涛	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

红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(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[2023]404 号核准,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《红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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人民币 6,917,815,516.85 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(2023)第 0316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2023 年 5 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 6,917,815,516.85 份基金份额,无利息折份额。本基金的基金管理人为红土创新管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金每个开放日开放申购,但对每份基金份额设置 7 天的最短持有期。同时,本基金开始办理赎回业务前,投资者不能提出赎回或转换转出申请。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》的有关规定,本基金的投资范围主要包括标的指数成份券及其备选成份券。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于标的指数成份券及其备选成份券以外的具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、地方政府债券、政府支持债券、政府

支持机构债券、金融债券、企业债券、央行票据、公司债券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分等)、非金融企业债务融资工具(中期票据、短期融资券、超短期融资券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、现金、货币市场工具及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)。本基金不投资股票等权益资产,也不投资可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,本基金可将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%;本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的标的指数为中证同业存单 AAA 指数,由中证指数有限公司编制发布。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围;如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制,在履行适当程序后,以变更后的比例为准,本基金的投资比例将相应调整。本基金的业绩比较基准为:中证同业存单 AAA 指数收益率 \times 95%+银行人民币一年定期存款利率(税后) \times 5%。

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》、《红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金合同》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

无。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	136,941.36
等于：本金	136,909.07
加：应计利息	32.29
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	136,941.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	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	-	-	-
	银行间市场	336,357,830.50	2,180,466.01	338,747,466.01
	合计	336,357,830.50	2,180,466.01	338,747,466.01
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	336,357,830.50	2,180,466.01	338,747,466.01	209,169.50

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

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	64,538.62
其中：交易所市场	-
银行间市场	64,538.62
应付利息	-
预提费用	104,972.24
合计	169,510.86

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,163,977,345.35	1,163,977,345.35
本期申购	43,757,928.00	43,757,928.00
本期赎回（以“-”号填列）	-930,427,197.19	-930,427,197.19
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	277,308,076.16	277,308,076.16

注：申购含红利再投、级别调整入份额。赎回含级别调整出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,825,639.56	1,770,413.79	11,596,053.35
本期期初	9,825,639.56	1,770,413.79	11,596,053.35
本期利润	5,960,713.53	-993,374.71	4,967,338.82
本期基金份额交易产生的变动数	-9,774,851.54	-697,718.23	-10,472,569.77
其中：基金申购款	781,163.12	19,800.69	800,963.81
基金赎回款	-10,556,014.66	-717,518.92	-11,273,533.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,011,501.55	79,320.85	6,090,822.40

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,043.76
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	0.02
其他	143.96
合计	1,187.74

6.4.7.14 股票投资收益

无。

6.4.7.15 债券投资收益

无。

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	6,052,402.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,968,216.50
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	8,020,619.07

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,116,766,730.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,082,180,241.79
减：应计利息总额	32,529,970.20
减：交易费用	88,302.50
买卖债券差价收入	1,968,216.50

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

1. 交易性金融资产	-993,374.71
股票投资	-
债券投资	-993,374.71
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	-993,374.71

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	36,299.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,793.97
上清所证书使用费	600.00
上清所债券托管帐户维护费	13,500.00
中债登债券托管帐户维护费	13,500.00
银行间账户维护费	360.00
合计	128,726.21

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”）	基金销售机构

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 5 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	429,896.42	1,175,505.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	211,637.83	-
应支付基金管理人的净管理费	218,258.59	1,175,505.99

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 0.2% 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×0.2%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 5 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	107,474.14	293,876.52

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
红土创新基金	116.14
建设银行	428,493.06
合计	428,609.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2023 年 5 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
合计	-

注：销售服务费按前一日基金资产净值 0.2% 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：

销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.2% / 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固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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 5 月 30 日（基金合同生效日）至 2023 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
建设银行	136,941.36	1,043.76	5,414,442.23	576,365.26

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（2024 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

无。

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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
112408143	24 中信银行 CD143	2024 年 7 月 1 日	98.44	228,000	22,444,076.39

112410090	24 兴业银行 CD090	2024 年 7 月 1 日	98.51	250,000	24,627,749.32
112418097	24 华夏银行 CD097	2024 年 7 月 1 日	98.44	230,000	22,641,377.70
合计				708,000	69,713,203.41

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

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，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主要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；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。

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,009,528.77	50,620,710.38
合计	20,009,528.77	50,620,710.38

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	246,792,180.96	1,011,997,604.28
合计	246,792,180.96	1,011,997,604.28

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	51,468,904.91	40,470,288.52
AAA 以下	-	-
未评级	20,476,851.37	82,122,855.19
合计	71,945,756.28	122,593,143.71

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于开放期内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于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本期末，除卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2024 年 6 月 30 日					
资产					
货币资金	136,941.36	-	-	-	136,941.36
存出保证金	10,212.99	-	-	-	10,212.99
交易性金融资产	338,747,466.01	-	-	-	338,747,466.01
应收申购款	-	-	-	10,000,000.00	10,000,000.00
资产总计	338,894,620.36	-	-	10,000,000.00	348,894,620.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	47,434.89	47,434.89
应付托管费	-	-	-	11,858.76	11,858.76
卖出回购金融资产款	65,214,717.26	-	-	-	65,214,717.26
应付销售服务费	-	-	-	47,434.89	47,434.89
应交税费	-	-	-	4,765.14	4,765.14
其他负债	-	-	-	169,510.86	169,510.86
负债总计	65,214,717.26	-	-	281,004.54	65,495,721.80
利率敏感度缺口	273,679,903.10	-	-	9,718,995.46	283,398,898.56
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	786,554.11	-	-	-	786,554.11
存出保证金	35,468.02	-	-	-	35,468.02
交易性金融资产	1,185,211,458.37	-	-	-	1,185,211,458.37
应收申购款	-	-	-	-239,974,052.61	239,974,052.61
资产总计	1,186,033,480.50	-	-	-239,974,052.61	1,426,007,533.11
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	140,711.23	140,711.23
应付托管费	-	-	-	35,177.80	35,177.80
卖出回购金融资产款	249,849,081.94	-	-	-	249,849,081.94
应付销售服务费	-	-	-	140,711.23	140,711.23
应交税费	-	-	-	3,289.80	3,289.80
其他负债	-	-	-	265,162.41	265,162.41
负债总计	249,849,081.94	-	-	585,052.47	250,434,134.41
利率敏感度缺口	936,184,398.56	-	-	-239,389,000.14	1,175,573,398.70

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）

1. 市场利率下降 25 个基点	487,766.30	2,069,856.21
2. 市场利率上升 25 个基点	-485,923.88	-2,061,875.50

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 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	338,747,466.01	1,185,211,458.37
第三层次	-	-
合计	338,747,466.01	1,185,211,458.37

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	338,747,466.01	97.09
	其中：债券	338,747,466.01	97.09
	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	-	-
	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	136,941.36	0.04
8	其他各项资产	10,010,212.99	2.87
9	合计	348,894,620.36	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

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,009,528.77	7.06
	其中：政策性金融债	20,009,528.77	7.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,945,756.28	25.39
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	246,792,180.96	87.08
9	其他	-	-
10	合计	338,747,466.01	119.53

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	112416118	24 上海银行 CD118	250,000	24,969,133.33	8.81
2	112498581	24 宁波银行 CD039	250,000	24,942,785.87	8.80
3	112403154	24 农业银行 CD154	250,000	24,657,804.76	8.70
4	112410090	24 兴业银行 CD090	250,000	24,627,749.32	8.69
5	112411063	24 平安银行 CD063	250,000	24,610,193.15	8.68
6	112418097	24 华夏银行 CD097	250,000	24,610,193.15	8.68

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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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未出现被监管部门立案调查，或在报告编辑日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	10,212.99
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,000,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,010,212.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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 (%)
1,005	275,928.43	27,023,306.91	9.74	250,284,769.25	90.26

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	50.00	0.0000

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

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2023 年 5 月 30 日) 基金份额总额	6,917,815,516.85
本报告期期初基金份额总额	1,163,977,345.35
本报告期基金总申购份额	43,757,928.00
减：本报告期基金总赎回份额	930,427,197.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	277,308,076.16

§ 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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，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

本基金聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

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

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 (%)	
安信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	6	-	-	-	-	-
中邮证券	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 (%)

安信证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	19,991,438. 00	100.00	-	-	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-

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旗下部分基金新增华夏银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 3 月 14 日
2	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 3 日
3	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增邮储银行（“邮你同赢”平台）为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 8 日
4	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金元证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 8 日
5	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增京东肯特瑞为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 9 日
6	红土创新基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在盈米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、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 9 日
7	红土创新基金管理有限公司关于旗下	中国证监会基金电子披	2024 年 4 月 10 日

	部分基金新增中信建投为销售机构的公告	露网站、规定报社及本公司网站	
8	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 4 月 24 日
9	红土创新基金管理有限公司关于谨防不法分子假冒“红土创新基金”名义进行非法活动的声明	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 7 日
10	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 17 日
11	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海挖财基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 29 日
12	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京雪球基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 31 日
13	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 5 月 31 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宝证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 3 日
15	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增恒泰证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 12 日
16	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、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 17 日
17	红土创新基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 27 日
18	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产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 年 6 月 29 日
19	红土创新基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报社及本公司网站	2024 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金设立的文件
- (2) 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合同
- (3) 红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 报告期内红土创新中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

公司网站：www.htcxfund.com

红土创新基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日