

国开泰富货币市场证券投资基金 2016 年 年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：国开泰富基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 20 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、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。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国开泰富货币市场证券投资基金	
基金简称	国开货币	
基金主代码	000901	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 1 月 14 日	
基金管理人	国开泰富基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	668, 046, 044. 89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国开货币 A	国开货币 B
下属分级基金的交易代码:	000901	000902
报告期末下属分级基金的份额总额	188, 884, 267. 13 份	479, 161, 777. 76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下，依据宏观经济、货币政策、财政政策和短期利率变动预期，综合考虑各投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况，进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的高流动性、低风险品种。本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、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	国开泰富基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	肖强
	联系电话	010 5936 3088
	电子邮箱	xiaoqiang@cdbsfund. com
客户服务电话	010 5936 3299	95599
传真	010 5936 3220	010-68121816
注册地址	北京市怀柔区北房镇幸福西街 3 号 416 室	北京市东城区建国门内大街 69
办公地址	北京市东城区朝阳门北大街 7 号五矿广场 C 座 10 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100010	100031
法定代表人	崔智生	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cdbsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和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	2016 年		2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	国开货币 A	国开货币 B	国开货币 A	国开货币 B
本期已实现收益	4,430,860.45	10,416,537.65	12,116,798.99	5,905,199.60
本期利润	4,430,860.45	10,416,537.65	12,116,798.99	5,905,199.60
本期净值收益率	2.9925%	3.2396%	3.4670%	3.7087%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
期末基金资产净值	188,884,267.13	479,161,777.76	94,629,315.89	191,859,141.61
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	2016 年末		2015 年末	
累计净值收益率	6.5633%	7.0684%	3.4670%	3.7087%

注：1. 本基金无持有人认购或交易基金的各项费用；

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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，由于本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；

3. 本基金基金合同生效日为 2015 年 1 月 14 日，本基金收益按月结转份额。

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

国开货币 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	0.6356%	0.0062%	0.3403%	0.0000%	0.2953%	0.0062%
过去六个月	1.4725%	0.0121%	0.6805%	0.0000%	0.7920%	0.0121%
过去一年	2.9925%	0.0116%	1.3537%	0.0000%	1.6388%	0.0116%
自基金合同生效起至今	6.5633%	0.0130%	2.6556%	0.0000%	3.9077%	0.0130%

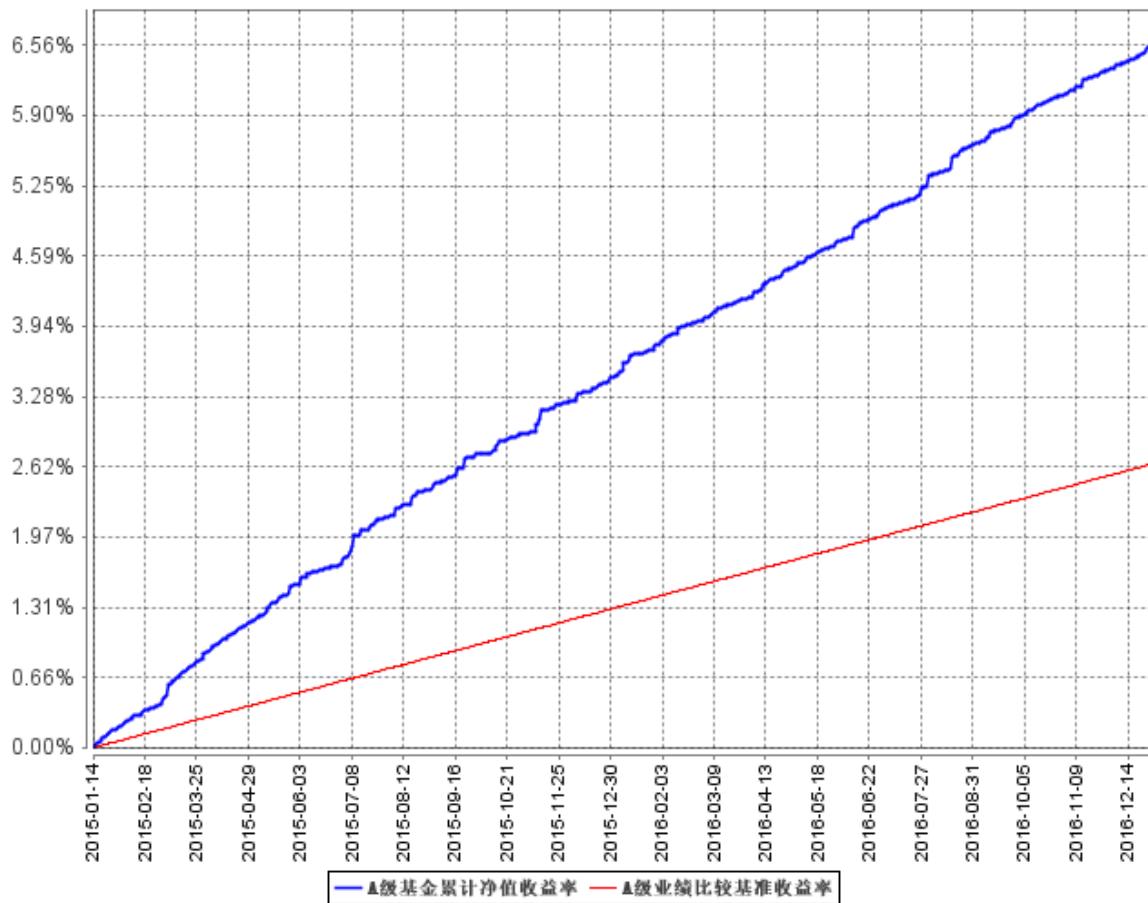
国开货币 B

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	0.6964%	0.0062%	0.3403%	0.0000%	0.3561%	0.0062%
过去六个月	1.5947%	0.0121%	0.6805%	0.0000%	0.9142%	0.0121%
过去一年	3.2396%	0.0116%	1.3537%	0.0000%	1.8859%	0.0116%
自基金合同生效起至今	7.0684%	0.0130%	2.6556%	0.0000%	4.4128%	0.0130%

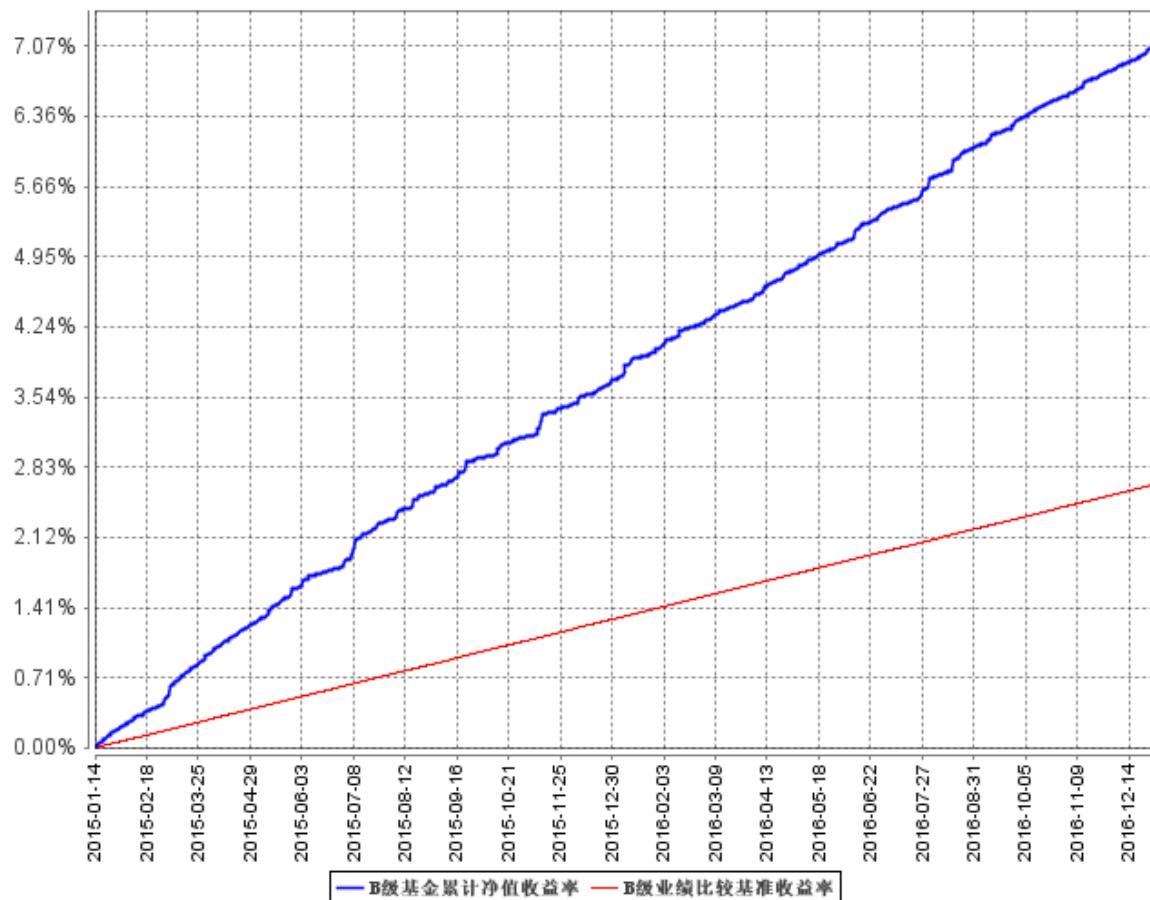
注：本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）。

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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B 级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

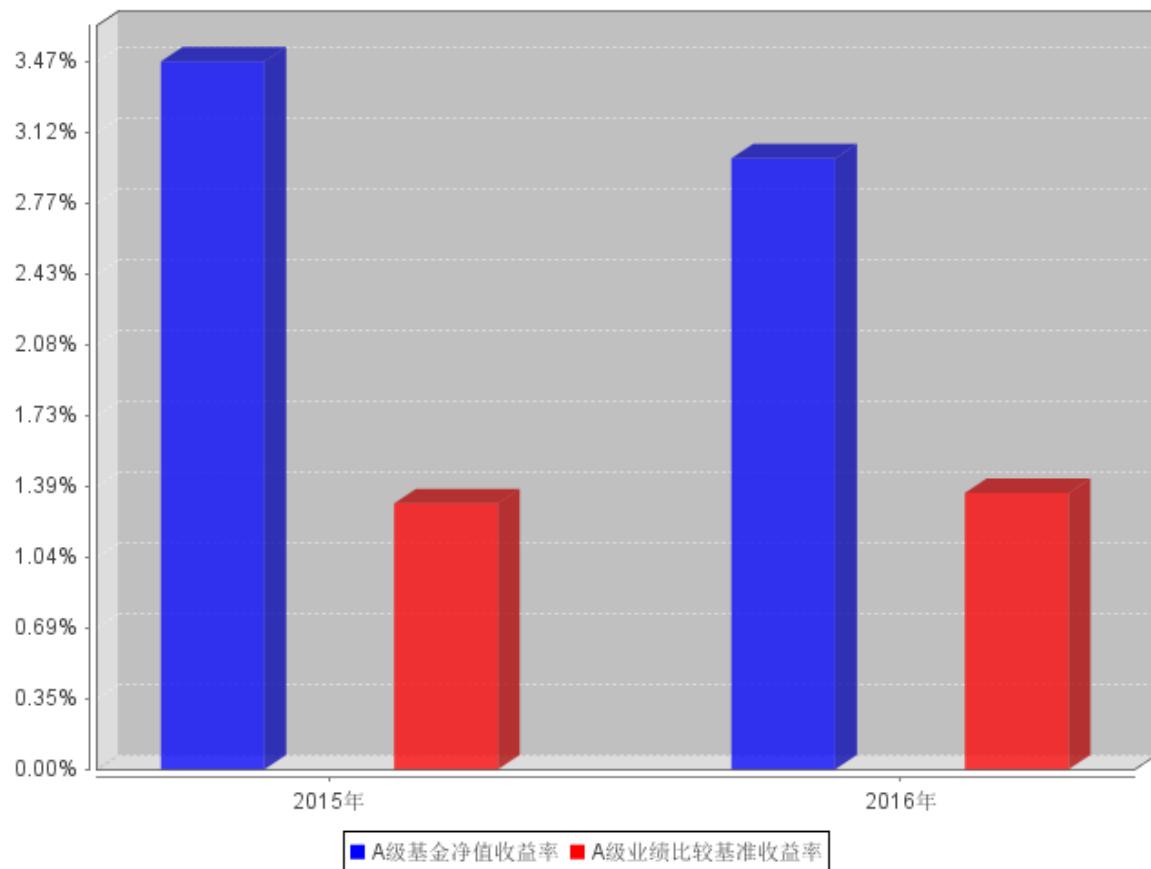


注：1、本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）；

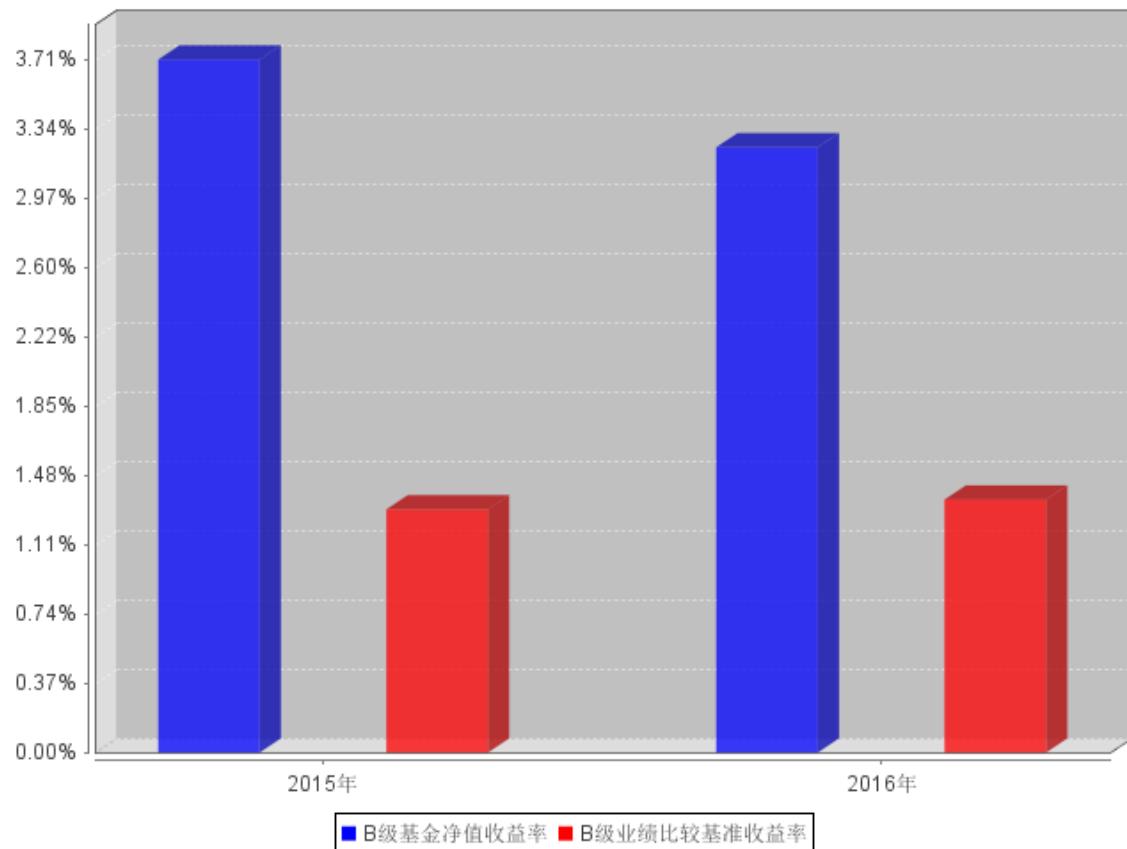
2、本基金基金合同于 2015 年 1 月 14 日生效，至本报告期末未满 1 年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

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:本基金基金合同生效日为 2015 年 1 月 14 日,2015 年度的相关数据根据当年实际存续期(2015 年 1 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日)计算。

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

国开货币 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
2016	4,409,763.61	—	21,096.84	4,430,860.45	
2015	12,114,042.93	—	2,756.06	12,116,798.99	
合计	16,523,806.54	—	23,852.90	16,547,659.44	

单位: 人民币元

国开货币 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
2016	10,356,669.70	—	59,867.95	10,416,537.65	
2015	5,898,389.89	—	6,809.71	5,905,199.60	

合计	16,255,059.59	-	66,677.66	16,321,737.25	
----	---------------	---	-----------	---------------	--

§ 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

国开泰富基金管理有限责任公司于 2013 年 6 月 28 日正式获得中国证券监督管理委员会批准成立，公司注册地位于北京市，注册资本为人民币贰亿元整，其中国开证券有限责任公司出资比例为 66.7%，国泰证券投资信托股份有限公司出资比例为 33.3%。公司经营范围包括：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理 3 只开放式基金，分别是：国开泰富岁月鎏金定期开放信用债券型证券投资基金、国开泰富货币市场证券投资基金、国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金。同时，公司还管理多个特定客户资产管理计划。

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		
洪宴	投资部总经理，本基金基金经理	2015 年 1 月 14 日	-	3 年 1 个月	北京大学光华管理学院商务统计与经济计量专业硕士，曾任中国光大银行资金部投资交易处处长，货币与债券交易处副处长（主持工作），货币与债券交易处业务副经理/经理；特许金融分析师（CFA）、加拿大证券业协会（CSI）衍生品交易资格（DFC）认证，曾获 2010 年及 2012 年全国银行间本币市场优秀交易主管。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制订了《公平交易管理制度》、《异常交易监控管理制度》，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求证券投资的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，享有公平的投资机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，实施集中交易制度，各组合享有平等的交易权利。对于部分债券一级市场申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制订了《公平交易管理制度》、《异常交易监控管理制度》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖债券、股票时候的价格和市场价格差距较大，可能存在利益输送、操纵股价等违法违规情况进行监控。

本报告期内，公平交易制度执行情况良好，报告期内未出现清算不到位的情况，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未存在法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未出现异常交易的情况。报告期内，本公司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

2016 年初，债券市场在配置压力和股市、汇市暴跌等因素的影响下，收益率大幅下行，但一季度末出现一些变化。首先，在房地产和基建的带动下，经济出现一些好转迹象。3 月中国制造业采购经理指数（PMI）为 50.2%，重回扩张区间；中国非制造业商务活动指数为 53.8%，比上月回升 1.1 个百分点。其次，在鲜菜和猪肉以及大宗商品的带动下，2 月 CPI 环比上涨 1.6%，环比涨幅创 2008 年 2 月以来新高，PPI 环比下跌 0.3%、跌幅收窄 0.2 个百分点，同时 PPI 同比跌幅较前月收窄 0.4 个百分点至 4.9%，通胀预期抬头。此外，资金面受春节、央行公开市场操作、季末、央行 MPA 评估等因素影响，呈现波动加大、时点紧张的状态。在上述因素的共同作用下，债券市场收益率从 3 月底开始大幅上行，利率品平均回调幅度达 50BP 左右，部分中低评级的信用债因二级流动性快速衰竭，利率回调幅度甚至高达 100BP。

随着二季度各月份数据的陆续公布，市场焦点重新回到经济复苏的可持续性上来。社会消费品零售总额同比名义增速从一季度末 10.5%回落至 5 月份的 10%；全国固定资产投资（不含农户）同比增速从一季度末的 10.7%持续回落至 5 月末的 9.6%，而民间固定资产投资自年初以来一路大幅下滑，自年初 10.1%增速下滑至 3.9%，经济增长承压预期重新占据市场主流。与此同时，6 月份飞出英国脱欧“黑天鹅”，脱欧派在公投中胜出，大幅提升了全球的避险情绪，全球多国 10 年期公债利率步入负利率时代，市场对美联储的加息预期也大幅削弱甚至转为降息，国内债市利率跟随快速下行。信用债方面，受 4 月中铁物资、中城建先后违约事件冲击，机构风险偏好大幅下降，资金纷纷涌入利率类、高等级及城投类信用债，使得该类债券收益重新逼近年内低点。

8 月中旬公布了 7 月份的经济、金融数据后，在较差的经济数据和弱经济企业融资需求导致的“资产荒”带动下，收益率下行突破前期低点。此时，市场出现一些新的变化。一是，本轮收益率下行幅度较大，机构获利颇丰，在收益率突破前期低点后，止盈压力剧增；二是，央行重启 14 天逆回购，降准难产，银行资金成本提高，机构加杠杆行为受限；三是，中观数据如工业企业利润等却表现良好，经济悲观预期有所修正；四是，美联储官员讲话鹰派，美国加息概率上升，人民币贬值压力增大。由于三季度入市资金规模较大，配置压力推动一级发行利率创年内新低，交投情绪空前热络，对前述利空的反映不甚充分。

10 月 13 日美联储公布 9 月会议纪要后，美元 2017 年加息节奏预期加快，人民币贬值预期升温，资金流出压力陡增。叠加央行国庆节后在公开市场持续、大量回收流动性，10 月中下旬后资金相对偏紧，市场交易拥挤，机构获利了结心态较重，债市交投情绪脆弱。11 月至年末，在央行或将表外理财纳入广义信贷核算，资金投放有赖央行续作 MLF，特朗普当选后美国财政政策加码、

通胀预期走高，新发布统计数据普遍超预期的重重利空下，市场短端利率水平显著抬升、息差缩窄、银行、保险大量赎回基金，导致“赎回基金——被动抛售——净值下跌”的螺旋式踩踏拥挤交易，10 年期国债与国开债一度上行至 3.4%与 4.0%上方，收益率上行速度与幅度甚至超越 2013 年“钱荒”，而债市的极速大幅调整，也危机整个金融体系与实体经济直接融资的稳定。在此背景下，12 月下旬央行加大投放力度，并引导大行向非银金融机构融出，资金紧张状况有所改善，债市情绪才有所企稳。至年末，与 8 月中旬的利率低点相比，10 年期国债、国开债估值上行 36、64 个基点，3 年期、5 年期 AA+ 中票估值上行 107、88 个基点。

本基金一季度基于利率将呈现区间窄幅波动的判断，在维持一定杠杆水平的同时，对信用债加快交易频率，通过“一级申购，二级卖出”的方式，博取一级价差，三月底策略转向防御。二季度基于对宏观基本面偏悲观的预期、利率的大幅调整，本基金策略上由防御逐步转向中性偏乐观，加大了对高等级信用债的波段操作，增强组合收益。至三季度末，基于债券绝对收益、期限与信用利差均处于历史低位的状况，以及元旦及春节前资金规律性偏紧的预期，本基金对债市观点趋于谨慎，策略上转向防守，逐步减持债券、提升货币市场资金比例。但债市“踩踏式”调整的力度与速度还是超于了预期，在恐慌性抛压下，一方面重点做好杠杆与久期的控制以及日常流动性管理，另一方面也在研判市场调整的顶部信号。10 年期国债调整到 3.4%、10 年期国开债上行至 4%以上，基本达到历史均值水平；而银行同业存单最高利率接近 4.8-5.0%，倒逼企业类信用债发行利率水涨船高，或者纷纷取消发行，大幅度抬高了实体经济的融资成本，无疑不利于经济的持稳复苏；中长期信用债，二级交易利率水平超越同期限银行贷款基准利率 10-20%，债券直接融资相比贷款，优势不在；央行窗口指导银行类机构要确保非银类机构正常流动性需求……种种信号也暗示，债市调整阶段性接近尾声，故在下旬，本基金重点以银行存单为标的，适当增持 1-3 月银行存单，锁定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，国开货币 A 净值增长率 2.9925%，国开货币 B 净值增长率 3.2396%，业绩比较基准收益率为 1.3537%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年四季度国内债市大跌的原因主要有以下五个。第一，通胀预期抬头。随着煤炭行业供给侧改革加码，9 月末秦皇岛港山西产动力煤均价已站上 500 元/吨，PPI 结束连续 54 个月下降态势、同比增速由负转正；受旺季来临下游电厂补库带动，10 月秦皇岛港山西产动力煤价继续上涨 10%至 550 元/吨，PPI 同比增速跳升至 1.2%。第二，经济失速证伪。10 月各地市商品房调控政策

出台后，居民部门新增中长期贷款规模仍在高位，11 月的 5692 亿元更是创年内新高，10 月、11 月的房地产开发投资同比增速也维持在 6.5%-6.6% 的较高水平，市场对基本面的过度悲观预期需要修正。第三，央行加强表外理财监管。10 月下旬多家媒体报道称央行有意将银行表外理财业务纳入广义信贷范围，引导金融机构加强对表外业务风险的管理。央行规范商业银行表外理财，体现金融去杠杆意图，或使债市新增资金减少，引发估值回落。第四，四季度美元指数强势突破 103，10 年美债利率上行 70bp、回到 2.40% 上下，中美利差收窄、人民币汇率承压，资金面紧张预期更加恶化。第五，前三季度外汇占款持续流出，央行以公开市场操作、中期借贷便利等手段代替降准，向市场投放流动性，同时在操作中提高 6 个月和 1 年期资金占比，一旦到期未续做，资金市场供需失衡将加剧，资金价格中枢抬高、波动增大。

通胀预期抬头、基本面失速证伪、央行加码监管、美元加息落地，对债市资产端继续上涨构成压力。而四季度短端资金利率居高不下，拉低杠杆收益，成为压垮债市的最后一根稻草。最终，银行、保险大量赎回基金，二级抛盘不断涌出，债市发生踩踏，中债新综合指数（财富）一度吐回 2016 年 3 月以来全部涨幅，中债总净价指数跌破年初水平、回到 2015 年 3 季度左右的位置。

目前来看，除人民币贬值压力有所缓解外，政策收紧和基本面回暖仍令债市承压。首先，2016 年 3 季度以来，央行逐渐拉长逆回购、MLF 资金投放期限，上调 MLF、逆回购招标利率，并利用 TLF 满足春节现金需求，货币政策中性偏紧，资金价格中枢上移。预计年内资金面将继续维持紧平衡，从负债端倒逼金融去杠杆。第二，银行表外理财 2017 年一季度正式纳入广义信贷，进入 MPA 考核范围，通过差额准备金制度，对流动性和信用扩张符合要求的机构进行准备金奖励，促使表内和表外资产负债扩张可控。第三，1 月官方制造业 PMI 51.3，连续 6 个月高于荣枯线，欧美英日综合 PMI 均在荣枯线上方，表明内外部需求短期改善、经济动能仍稳。且 2017 年 1、2 月实体经济数据缺失，1 月新增社融 3.74 万亿、创历史新高，基本面企稳短期内难以证伪。第四，1 月 CPI 同比上涨 2.5%、创两年半新高，PPI 同比上涨 6.9%、创逾五年新高，双双超出预期。考虑到节后钢铁、水泥、有色金属等行业供给侧改革逐渐展开，环保督察趋严引发停限产，OPEC 达成减产协议稳定油价预期，2 月 PPI 同比增速将突破 7%，前三季度均位于高位。

因此，短期内金融去杠杆下偏紧的货币政策基调，令市场对资金面始终保持较高的警惕。在 2017 年一季度理财纳入 MPA 考核、同业及理财等监管政策落地之前所带来的不确定性，资金宽松与阶段性紧张并存，波动较大，需要紧密跟踪央行操作、线下线上资金价格等多个市场，合理安排资金期限结构，把流动性管理放到更大突出的位置上，在此基础上，充分利用短期资金曲线陡峭化形态，适度杠杆与发挥骑乘效应，增强收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部门、风险控制部门定期与不定期的对基金的投资、研究、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的合规审核及监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；通过信息技术建立多级投资交易预警系统；完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；根据新出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和业务流程；加强法律法规的教育和培训，促进公司合规文化的建设；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、当地证监局和公司董事会。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.7.1.1 职责分工

参与估值小组成员为 6 人，分别是公司基金运营部负责人、基金运营部估值会计、投资部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人、监察稽核部（法律合规部）负责人，组长由基金运营部负责人担任。

各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经公司分管基金运营部的经理层成员批准同意。

4.7.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.7.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书等有关规定，本基金根据每日基金收益情况，以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，每月集中支付。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

无。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国开泰富基金管理有限责任公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，国开泰富基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，国开泰富基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

本年度报告被出具了无保留意见的审计报告，且在审计报告中无强调事项，投资者欲了解详

细内容，可阅读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：国开泰富货币市场证券投资基金

报告截止日： 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	33, 516, 406. 70	182, 095. 53
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7.4.7.2	418, 596, 483. 96	251, 249, 626. 94
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		418, 596, 483. 96	251, 249, 626. 94
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	223, 401, 215. 10	48, 000, 512. 00
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	5, 987, 264. 61	7, 436, 543. 00
应收股利		—	—
应收申购款		8, 288, 216. 91	164, 200. 00
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		689, 789, 587. 28	307, 032, 977. 47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		20, 994, 768. 51	19, 999, 790. 00
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		167, 285. 62	78, 371. 76
应付托管费		50, 692. 58	23, 749. 00
应付销售服务费		47, 027. 40	23, 774. 32

应付交易费用	7.4.7.7	30,647.74	49,120.73
应交税费		—	—
应付利息		3,589.98	1,148.39
应付利润		90,530.56	9,565.77
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	359,000.00	359,000.00
负债合计		21,743,542.39	20,544,519.97
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	668,046,044.89	286,488,457.50
未分配利润	7.4.7.10	—	—
所有者权益合计		668,046,044.89	286,488,457.50
负债和所有者权益总计		689,789,587.28	307,032,977.47

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 668,046,044.89 份。

7.2 利润表

会计主体：国开泰富货币市场证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 14 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		19,158,911.74	21,516,259.54
1.利息收入		17,726,457.93	18,586,273.54
其中：存款利息收入	7.4.7.11	634,061.82	12,318,378.52
债券利息收入		13,291,916.34	3,829,481.77
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		3,800,479.77	2,438,413.25
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,432,453.81	2,924,986.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	1,432,453.81	2,924,986.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	—	—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—
股利收益	7.4.7.16	—	—
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	7.4.7.17	—	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填 列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填	7.4.7.18	—	5,000.00

列)			
减：二、费用		4,311,513.64	3,494,260.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,658,477.34	1,562,571.33
2. 托管费	7.4.10.2.2	502,568.95	473,506.40
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	425,887.80	812,956.87
4. 交易费用	7.4.7.19	—	—
5. 利息支出		1,287,534.51	211,536.70
其中：卖出回购金融资产支出		1,287,534.51	211,536.70
6. 其他费用	7.4.7.20	437,045.04	433,689.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,847,398.10	18,021,998.59
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,847,398.10	18,021,998.59

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国开泰富货币市场证券投资基金管理人

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	286,488,457.50	—	286,488,457.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	14,847,398.10	14,847,398.10
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)	381,557,587.39	—	381,557,587.39
其中：1. 基金申购款	4,006,361,192.84	—	4,006,361,192.84
2. 基金赎回款	-3,624,803,605.45	—	-3,624,803,605.45
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）	—	-14,847,398.10	-14,847,398.10
五、期末所有者权益（基金净值）	668,046,044.89	—	668,046,044.89
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 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）	4,334,110,479.17	-	4,334,110,479.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,021,998.59	18,021,998.59
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)	-4,047,622,021.67	-	-4,047,622,021.67
其中：1. 基金申购款	1,353,492,860.28	-	1,353,492,860.28
2. 基金赎回款	-5,401,114,881.95	-	-5,401,114,881.95
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）	-	-18,021,998.59	-18,021,998.59
五、期末所有者权益（基金净值）	286,488,457.50	-	286,488,457.50

注：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：

李鑫

张智

姚勐

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

国开泰富货币市场证券投资基金(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[2014]第 1145 号《关于准予国开泰富货币市场证券投资基金注册的批复》核准，由国开泰富基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国开泰富货币市场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 4,333,674,918.07 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(2015)第 014 号予以验证。经向中国证监会备案，《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,334,110,479.17 份基金份额，其中认购资金利息折合 435,561.10 份基金份额。本基金的基金管理人为国开泰富基金管理有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》和《国开泰富货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据基金份额持有人持有本基金份额的数量进行基金份额类别划分。本基金将设 A 类和 B 类两类基金份额，两类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，

两类基金份额单独设置基金代码，并单独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《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》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、资产支持证券；中国证监会及/或中国人民银行认可的其它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七天通知存款利率(税后)。

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》、《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告相一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国开泰富基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国开证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构
国泰证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东

注：以下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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,658,477.34	1,562,571.33
其中：支付销售机构的客户维护费	452,030.25	809,598.34

注：支付基金管理人国开泰富基金管理有限责任公司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 $\times 0.33\% / \text{当年天数}$ 。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	502,568.95	473,506.40

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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 $\times 0.10\% / \text{当年天数}$ 。

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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国开货币 A	国开货币 B	合计
国开泰富基金管理有限责任公司	8,187.97	24,219.51	32,407.48
中国农业银行股份有限公司	222,335.28	5,230.73	227,566.01
国开证券有限责任公司	659.70	—	659.70
合计	231,182.95	29,450.24	260,633.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国开货币 A	国开货币 B	合计
国开泰富基金管理有限责任公司	660.06	5,957.43	6,617.49
中国农业银行股份有限公司	754,221.57	9,306.12	763,527.69
国开证券有限责任公司	457.85	—	457.85
合计	755,339.48	15,263.55	770,603.03

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国开泰富基金管理有限责任公司，再由国开泰富基金管理有限责任公司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%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 \times 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

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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	
	2016年1月1日至2016年12月31日	
	国开货币A	国开货币B
期初持有的基金份额	-	30,376,067.16
期间申购/买入总份额	-	91,069,591.24
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	30,775,270.96
期末持有的基金份额	-	90,670,387.44
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	18.9227%

项目	上年度可比期间	
	2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	国开货币A	国开货币B
基金合同生效日(2015年1月14日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	65,436,043.19
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	35,059,976.03
期末持有的基金份额	-	30,376,067.16
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	15.8325%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额；

2. 基金管理人国开泰富基金管理有限责任公司在本年度/会计期间申购/赎回本基金的交易委托直销中心办理，无申购费和赎回费。

7.4.8.4.2 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

国开货币B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
国开证券有限责任公司	200,071,762.94	29.9488%	-	-

注：国开证券有限责任公司在本年度期间申购/赎回本基金的交易委托直销中心办理，无申购费和赎回费。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 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
中国农业银行	3,516,406.70	4,089.58	182,095.53	218,636.80

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国农业银行保管，活期银行存款按银行同业利率计息，定期银行存款按银行约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 利润分配情况

7.4.9.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

国开货币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
4,409,763.61	-	21,096.84	4,430,860.45	-

国开货币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
10,356,669.70	-	59,867.95	10,416,537.65	-

7.4.10 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 20,994,768.51，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
140407	14农发07	2017年1月3日	100.35	100,000	10,034,823.64
150408	15农发08	2017年1月3日	100.34	121,000	12,140,921.71
合计				221,000	22,175,745.35

7.4.10.3.2 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。

7.4.11 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。

§ 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	418,596,483.96	60.68
	其中：债券	418,596,483.96	60.68
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	223,401,215.10	32.39
	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	33,516,406.70	4.86
4	其他各项资产	14,275,481.52	2.07
5	合计	689,789,587.28	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	10.03	
	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	20,994,768.51	3.14
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注: 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	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注: 报告期内投资组合平均剩余限未超过 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	47.48	3.14
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	4.50	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	16.47	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.49	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
5	120 天(含)–397 天(含)	43.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮 动利率债	-	-
	合计	113.09	3.14

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

报告期内投资组合平均剩余限未超过 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,102,462.83	4.51
	其中：政策性金融债	30,102,462.83	4.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	299,920,675.91	44.90
6	中期票据	-	-
7	同业存单	88,573,345.22	13.26
8	其他	-	-
9	合计	418,596,483.96	62.66
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	011699628	16 陕煤化 SCP003	400,000	40,127,736.63	6.01
2	041669002	16 新兴 CP001	300,000	30,116,561.96	4.51
3	011698353	16 首钢 SCP003	300,000	30,014,873.21	4.49
4	041667007	16 富兴 CP001	200,000	20,172,002.91	3.02
5	150408	15 农发 08	200,000	20,067,639.19	3.00
6	041651011	16 保利久联 CP001	200,000	20,039,924.33	3.00
7	041664002	16 武清国资 CP001	200,000	20,036,773.79	3.00
8	011698200	16 扬子大桥 SCP001	200,000	19,998,685.48	2.99
9	011698356	16 大北农科 SCP001	200,000	19,963,916.13	2.99
10	011698874	16 沪华信 SCP004	200,000	19,927,443.91	2.98

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

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	68
报告期内偏离度的最高值	0.4692%
报告期内偏离度的最低值	-0.2091%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2140%

注：表内各项数据均按报告期的交易日统计。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

8.8 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

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 本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.00 元。本基金估值采用摊余成本法，即估值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，在其剩余期限内按实际利率法摊销，每日计提收益或损失。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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	5,987,264.61
4	应收申购款	8,288,216.91
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	14,275,481.52

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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
国开 货币 A	5,678	33,265.99	4,577,275.77	2.42%	184,306,991.36	97.58%
国开 货币 B	13	36,858,598.29	434,569,685.31	90.69%	44,592,092.45	9.31%
合计	5,691	117,386.41	439,146,961.08	65.74%	228,899,083.81	34.26%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	国开货币 A	3,120.81	0.0017%
	国开货币 B	-	-
	合计	3,120.81	0.0005%

9.3 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	国开货币 A	0~10
	国开货币 B	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国开货币 A	0~10
	国开货币 B	-
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国开货币 A	国开货币 B
基金合同生效日(2015 年 1 月 14 日)基金 份额总额	3,050,089,390.02	1,284,021,089.15

本报告期期初基金份额总额	94,629,315.89	191,859,141.61
本报告期基金总申购份额	1,040,295,452.29	2,966,065,740.55
减:本报告期基金总赎回份额	946,040,501.05	2,678,763,104.40
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	188,884,267.13	479,161,777.76

注: 1. 报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2. 报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

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

2016 年 1 月 22 日通过第一届董事会第十次会议决议, 任命李鑫担任公司总经理。

2016 年 3 月 7 日通过股东会 2016 年第一次会议决议, 王翀离任公司董事。

2016 年 3 月 7 日通过股东会 2016 年第一次会议决议, 李鑫担任公司董事。

2016 年 7 月 16 日通过董事会换届郑文杰担任公司董事。

2016 年 7 月 16 日通过董事会换届刘迎生担任公司独立董事。

2016 年 7 月 16 日通过董事会换届崔智生离任公司董事。

2016 年 7 月 16 日通过董事会换届张维离任公司独立董事。

2016 年 7 月 18 日通过第二届董事会第一次会议决议, 郑文杰担任公司董事长(至 2017 年 1 月 6 日履行任职手续期间由总经理李鑫代行董事长职责)。

2016 年 7 月 18 日崔智生离任公司董事长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期没有改聘会计师事务所。

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

本基金管理人及其相关高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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

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	
海通证券	2	-	-	-	-	-

11.7.2 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
海通证券	-	-	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。