

国开泰富货币市场证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 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 8 月 25 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 08 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	263,051,718.95 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	193,593,635.40 份	69,458,083.55 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	林葛
	联系电话	010 5936 3088	010-66060069
	电子邮箱	xiaoqiang@cdbsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-59363299	95599
传真		010-59363220	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		郑文杰	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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cdbsfund.com
基金半年度报告备置地点	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

基金级别	国开货币 A	国开货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,996,896.22	6,365,651.29
本期利润	3,996,896.22	6,365,651.29
本期净值收益率	1.8948%	2.0161%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	193,593,635.40	69,458,083.55
期末基金份额净值	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	8.5824%	9.2270%

注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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；

3. 本基金基金合同生效日为 2015 年 1 月 14 日。

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
过去一个月	0.3561%	0.0078%	0.1110%	0.0000%	0.2451%	0.0078%
过去三个月	0.9666%	0.0064%	0.3366%	0.0000%	0.6300%	0.0064%
过去六个月	1.8948%	0.0071%	0.6695%	0.0000%	1.2253%	0.0071%

过去一年	3.3952%	0.0100%	1.3500%	0.0000%	2.0452%	0.0100%
自基金合同 生效起至今	8.5824%	0.0121%	3.3251%	0.0000%	5.2573%	0.0121%

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
过去一个月	0.3761%	0.0078%	0.1110%	0.0000%	0.2651%	0.0078%
过去三个月	1.0270%	0.0064%	0.3366%	0.0000%	0.6904%	0.0064%
过去六个月	2.0161%	0.0071%	0.6695%	0.0000%	1.3466%	0.0071%
过去一年	3.6430%	0.0100%	1.3500%	0.0000%	2.2930%	0.0100%
自基金合同 生效起至今	9.2270%	0.0121%	3.3251%	0.0000%	5.9019%	0.0121%

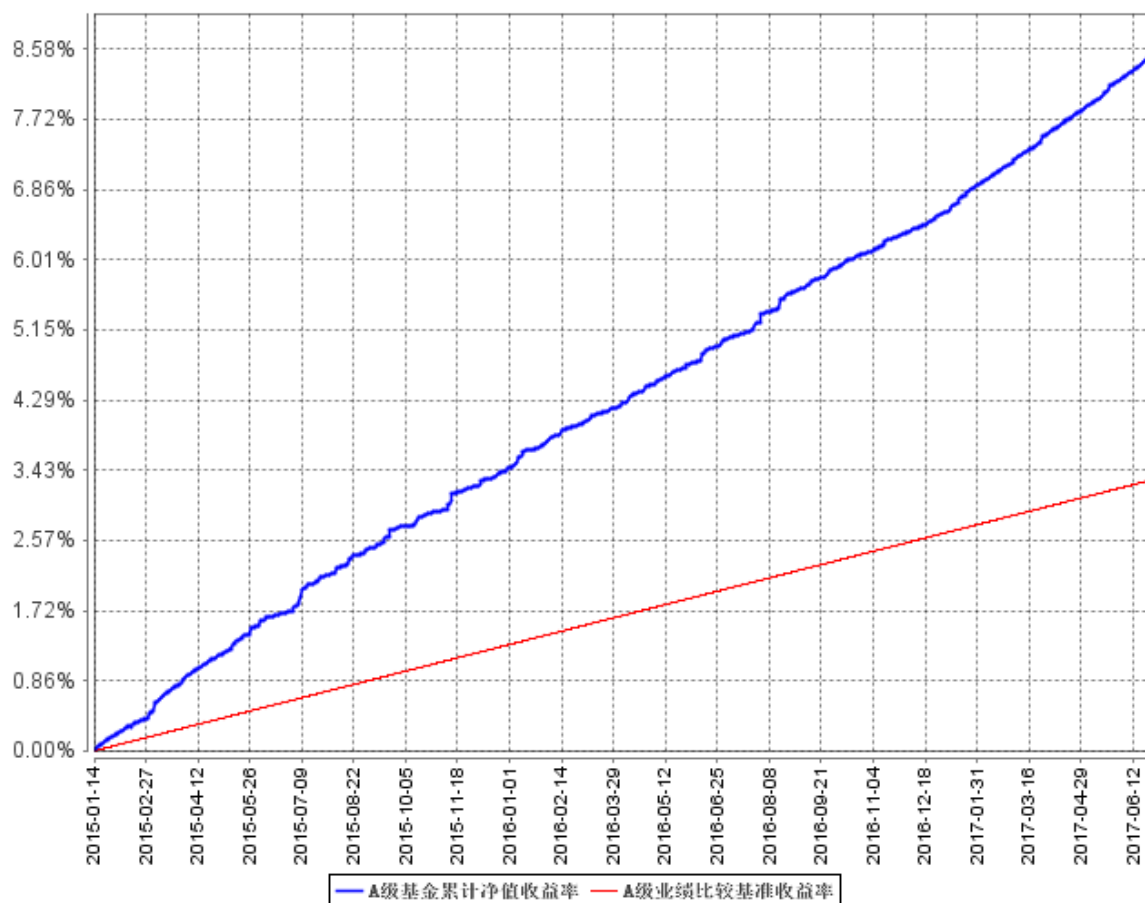
注：1、本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）；

2、本基金基金合同于 2015 年 1 月 14 日生效；

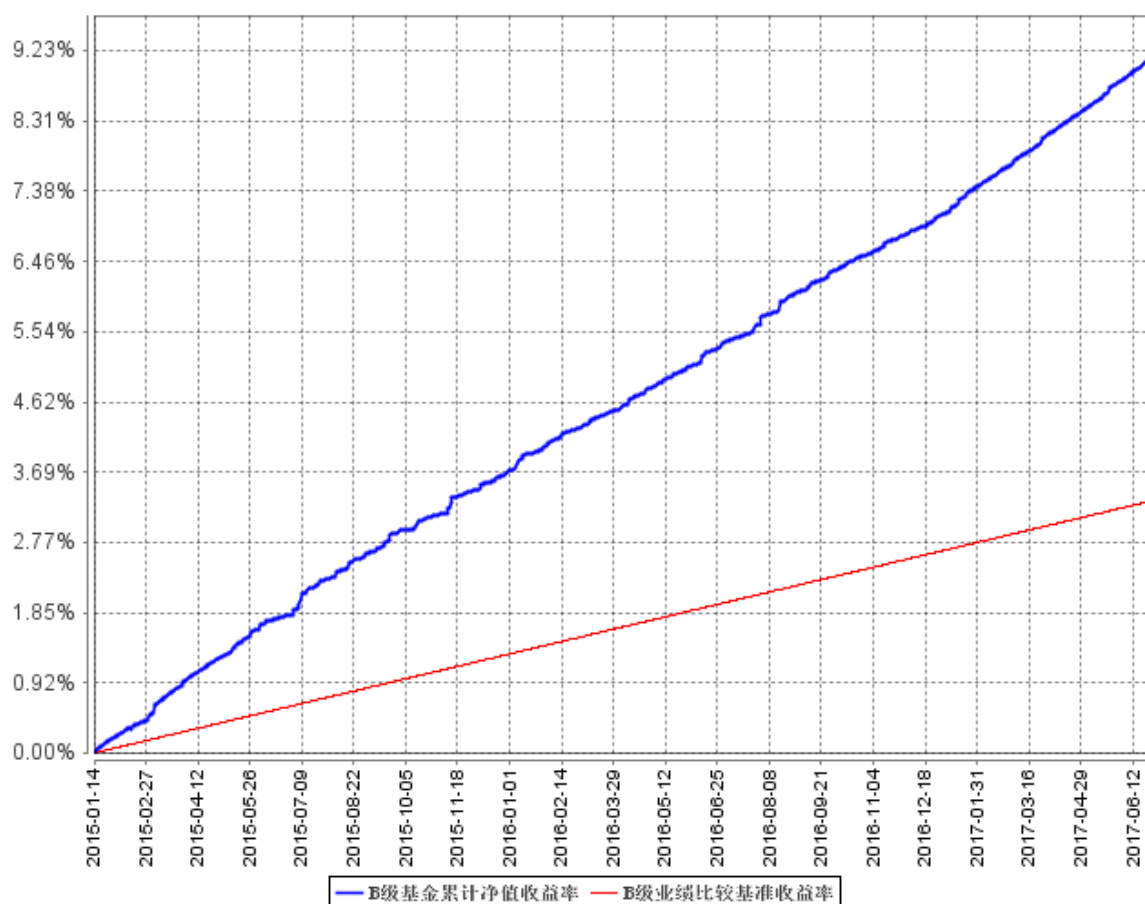
3、本报告期内，基金的投资组合比例已符合本基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

3.2.2 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；

3、本报告期内，基金的投资组合比例已符合基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

3.3 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

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 2017 年 6 月 30 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	投资总监，本基金基金经理	2015 年 1 月 14 日	—	3 年 11 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。
王婷婷	本基金基金经理	2017 年 3 月 27 日	—	6 年 11 个月	中央财经大学经济法专业硕士，曾任益民基金管理有限公司益民货币市场基金、益民多利债券混合型证券投资基金基金经理，交易部副总经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，报告期间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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，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

2017 年上半年，宏观经济延续 2016 年下半年以来稳中向好的发展趋势，GDP 实际同比增长 6.9%，一季度、二季度持平，展现了较强的韧性。在供给侧改革及库存周期带动下，煤炭、有色、钢铁、水泥等大宗商品价格上涨，上游及中游行业企业财务数据持续改善；固定资产投资方面，上半年全国房地产投资超预期同比增长 8.5%，得益于三四线城市地产投资、销售情况良好，基建方面持续发力，上半年财政支出较快，6 月份基建投资累计增速至 21.1%，而企业业绩的改善，也带动制造业、民间投资自年初低位持续回暖；进出口方面，全球经济复苏带动外需大幅改善，就出口国家来看，对美国和欧洲出口金额大幅提升，以美元计价，上半年出口累计同比增长 8.5%，进口累计同比增长 18.9%。

货币政策方面，在金融去杠杆防风险的政策主导下，央行货币政策稳健中性、维持紧平衡的状态，并于一季度跟随美联储加息而两次上调公开市场、中期借贷便利等工具利率，加上一季度末首次将商业银行表外理财纳入广义信贷考核，均抬升并支撑资金价格高位震荡。

在多重因素影响下，债券市场持续调整，长端利率债收益率几起几落，但收益率中枢不断上移。4 月下旬，“一行三会”密集出台相关文件，银监会先后发布“三违反”、“三套利”、“四不当”等 8 个文件，旨在对同业业务、资金空转及多层嵌套等问题进行摸底检查，保监会发布《中国保监会关于进一步加强保险业风险防控工作的通知》，明确指出了当前保险业风险较为突出的领

域，证监会督导证券公司对照法规开展资管业务自查，在“严监管”的引导下，债券市场继一季度后，再次出现了恐慌性的抛售，收益率大幅上行至上半年高点，5月初10年期国债收益率触及3.7%，10年期国开收益率上行至4.49%，各期限信用债收益率上行至同期贷款利率上浮百分之20%左右，个别信用债发行利率飙升至8%，信用债一级市场净融资大幅萎缩，同业存单发行量价齐升，AAA股份制商业银行3月存单利率发行至5%，负债成本大幅提升。

6月初央行呵护流动性，持续通过MLF、公开市场逆回购操作投放流动性，同时央行强调协调监管、货币政策不紧不松，也并未跟随美联储再次加息而上调公开市场操作相关品种利率，季末未出现以往流动性极端紧张的情况。在流动性充裕的带动下市场情绪有所修复，债券市场收益率高位大幅回落，10年期国债收益率下行至3.6%附近，10年期国开收益率下行至4.2%附近，持稳震荡，各期限信用债收益率均大幅下行，信用利差重新缩窄，并出现供需两旺行情，一级市场净融资额重新回到接近1万亿。

本基金密切关注市场流动性变化，针对货币市场及短期债券市场走势，重点处理申购资金再投资压力和季末大额赎回压力，在平衡流动性的基础上，上半年缩短组合久期，配置上以短久期中高等级信用债为主，增加短久期短期融资券、同业存单配置，维持较低的杠杆比例。同时着重提前应对缓解特殊时点资金压力，在临近6月末的货币市场资金紧张时，提前准备出应对流动性压力的资金，整体组合稳健而富有弹性，投资业绩优异。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期国开货币A的基金份额净值收益率为1.8948%，本报告期国开货币B的基金份额净值收益率为2.0161%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

资金方面，央行公开市场操作削峰填谷、不松不紧，预计不会出现极端紧张的情况，但仍会保持“稳健中性”的张力。宏观经济方面，全年通胀温和，地产投资放缓，但基建投资持续发力，经济韧性较强，预计宏观数据好于预期，不会出现断崖式下跌，但稳定的经济基本面为金融去杠杆推进提供了空间和时间。金融监管虽已取得一定成效，但加强监管、消除制度套利仍在进行中，随着自查及金融工作会议的召开，具体细则与措施也将进一步出台与落实。债券收益率在6月份急速下行后，长端政策性金融债利率重新回落至一季度末附近的水平，也令市场情绪趋于谨慎。同业存单跨过季末，发行利率虽有所回落，但存量规模仍高达8万亿以上，依然是银行类金融机构负债的重要来源之一，而存单、货币市场各期限利差仍维持较高水平，显示了机构对未来流动性依然保持较高的警惕性。在债券收益率曲线十分平坦的情况下，短端资金利率高企，也必将制约长端利率的下行空间。同时，由于市场对未来宏观经济的悲观预期较强，加上利率类债券相对

信贷基准收益对配置资金的吸引力，收益率也难以大幅上行，预计持稳震荡的可能性较大。

此外，6 月份以来，商品价格重新较大幅度回升，企业财务数据出现好转，煤炭、有色、钢铁、水泥等过剩产能龙头企业尤为突出，这些发行主体的信用利差有望逐步缩窄，但受制于去杠杆的政策以及民营企业信用事件的冲击，长久期低评级类信用债仍将面临一定的发行融资压力。

本基金投资组合在配置上，以控制仓位、控制久期、提高组合债券流动性为主，密切跟踪公开市场、货币市场、银行存单、短期及超短期融资券等各品种的收益变化，长短搭配，在保证组合流动性的同时，获取稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 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

4.6.1.1 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。

4.6.1.2 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。

4.6.2 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。

4.6.3 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。

4.6.4 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。

4.7 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。

4.8 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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

2017 年上半年度，基金托管人在国开泰富货币市场证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 托管人对本半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半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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：国开泰富货币市场证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	101,262.60	33,516,406.70
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	259,425,058.79	418,596,483.96
其中：股票投资		—	—

基金投资		-	-
债券投资		259,425,058.79	418,596,483.96
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	44,850,307.28	223,401,215.10
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,460,101.22	5,987,264.61
应收股利		-	-
应收申购款		457,764.22	8,288,216.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		307,294,494.11	689,789,587.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		43,709,658.14	20,994,768.51
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		112,001.57	167,285.62
应付托管费		33,939.86	50,692.58
应付销售服务费		49,587.25	47,027.40
应付交易费用	6.4.7.7	21,363.19	30,647.74
应交税费		-	-
应付利息		9,558.61	3,589.98
应付利润		124,105.64	90,530.56

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	182,560.90	359,000.00
负债合计		44,242,775.16	21,743,542.39
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	263,051,718.95	668,046,044.89
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		263,051,718.95	668,046,044.89
负债和所有者权益总计		307,294,494.11	689,789,587.28

注：1. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 263,051,718.95 份，其中国开货币 A 份额基金净值 1.00 元，基金份额总额 193,593,635.40 份；国开货币 B 份额基金净值 1.00 元，基金份额总额 69,458,083.55 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		12,912,720.96	9,551,641.59
1.利息收入		12,662,074.15	8,732,960.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	468,096.86	2,710.26
债券利息收入		10,098,286.89	7,575,412.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,095,690.40	1,154,837.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		250,646.81	818,681.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.13	250,646.81	818,681.53
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		2,550,173.45	1,986,653.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	898,959.69	818,920.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	272,412.04	248,157.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	285,250.91	164,637.83
4. 交易费用	6.4.7.19	100.00	-
5. 利息支出		872,646.12	536,778.02
其中：卖出回购金融资产支出		872,646.12	536,778.02
6. 其他费用	6.4.7.20	220,804.69	218,159.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,362,547.51	7,564,987.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,362,547.51	7,564,987.98

6.3 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

本报告期：2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	668,046,044.89	-	668,046,044.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,362,547.51	10,362,547.51
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)	-404,994,325.94	-	-404,994,325.94
其中：1. 基金申购款	985,159,744.20	-	985,159,744.20
2. 基金赎回款	-1,390,154,070.14	-	-1,390,154,070.14
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)	-	-10,362,547.51	-10,362,547.51
五、期末所有者权益(基金净值)	263,051,718.95	-	263,051,718.95
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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	-	7,564,987.98	7,564,987.98

期利润)			
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)	124,345,016.32	-	124,345,016.32
其中: 1. 基金申购款	1,993,900,753.94	-	1,993,900,753.94
2. 基金赎回款	-1,869,555,737.62	-	-1,869,555,737.62
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)	-	-7,564,987.98	-7,564,987.98
五、期末所有者权益(基金净值)	410,833,473.82	-	410,833,473.82

注: 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>李鑫</u>	<u>朱瑜</u>	<u>姚劼</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

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）。

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》、《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 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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[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。

6.4.7 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.1 关联方报酬

6.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30
----	----------------------------------	--

	30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	898,959.69	818,920.81
其中：支付销售机构的客户维护费	272,041.42	216,754.24

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	272,412.04	248,157.83

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.1.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	1,904.08	11,892.24	13,796.32
中国农业银行股份有限公司	120,260.80	1,810.66	122,071.46
国开证券有限责任公司	211.60	–	211.60
合计	122,376.48	13,702.90	136,079.38
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	6,356.50	12,622.36	18,978.86
中国农业银行股份有限公司	101,104.48	2,693.85	103,798.33
国开证券有限责任公司	327.12	–	327.12
合计	107,788.10	15,316.21	123,104.31

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支

付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

6.4.8.2 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。

6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.3.1 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	—	90,670,387.44
期间申购/买入总份额	—	6,592,171.56
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	64,000,000.00
期末持有的基金份额	—	33,262,559.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	12.6400%

项目	上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	—	30,299,263.56

期间申购/买入总份额	—	30,476,007.40
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	—	30,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	7.3000%

注：1. 本基金管理人运用固有资金投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率；

2. 期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额；

3. 基金管理人于 2017 年 5 月 11 日通过直销赎回国开货币 B 基金 10,000,000.00 份，赎回费率为零；2017 年 5 月 16 日通过直销赎回国开货币 B 基金 10,000,000.00 份，赎回费率为零；2017 年 5 月 23 日通过直销赎回国开货币 B 基金 20,000,000.00 份，赎回费率为零；2017 年 6 月 15 日通过直销赎回国开货币 B 基金 20,000,000.00 份，赎回费率为零；基金管理人于 2017 年 6 月 23 日通过在直销申购国开货币 B 基金 5,000,000.00 份，申购费率为零；2017 年 6 月 29 日通过直销赎回国开货币 B 基金 4,000,000.00 份，赎回费率为零。

6.4.8.3.2 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

份额单位：份

国开货币 B

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	29.9500%

注：1. 本基金除管理人之外的其他关联方投资本基金时所适用的费率为本基金基金合同中约定的费率；

2. 国开证券有限责任公司于 2017 年 2 月 24 日通过直销赎回国开货币 B 基金 100,000,000.00 份，赎回费率为零；2017 年 2 月 27 日通过直销赎回国开货币 B 基金 101,213,683.40 份，赎回费率为零。

6.4.8.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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。

6.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.8.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须做说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 43,709,658.14 元，是以如下债券作为质押：

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
111709220	17 浦发银行 CD220	2017 年 7 月 3 日	99.07	200,000	19,814,492.64
160419	16 农发 19	2017 年 7 月 3 日	99.95	100,000	9,995,120.83
111711234	17 平安银行 CD234	2017 年 7 月 3 日	99.01	145,000	14,356,618.39
合计				445,000	44,166,231.86

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 259,425,058.79 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 418,596,483.96 元，无属于第一层次或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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 2017 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(2016 年 12 月 31 日：无)。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	259,425,058.79	84.42
	其中：债券	259,425,058.79	84.42
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	44,850,307.28	14.60
	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	101,262.60	0.03
4	其他各项资产	2,917,865.44	0.95
5	合计	307,294,494.11	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。

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	10.17
	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	43,709,658.14	16.62
	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：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	40
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

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	55.08	16.62
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	30.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	22.66	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	7.60	-
	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		115.71	16.62

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

报告期内投资组合平均剩余限未超过 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	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	39,979,510.13	15.20
	其中：政策性金融债	39,979,510.13	15.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	139,938,083.52	53.20
6	中期票据	-	-
7	同业存单	79,507,465.14	30.23
8	其他	-	-
9	合计	259,425,058.79	98.62
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	071721006	17 渤海证 券 CP006	200,000	19,996,744.18	7.60
2	011754102	17 川投能 源 SCP001	200,000	19,995,483.81	7.60
3	011698538	16 大唐融 资 SCP001	200,000	19,995,112.79	7.60
4	011698906	16 陕煤化 SCP011	200,000	19,994,876.09	7.60
5	011698874	16 沪华信 SCP004	200,000	19,992,713.65	7.60
6	160419	16 农发 19	200,000	19,990,241.65	7.60
7	160308	16 进出 08	200,000	19,989,268.48	7.60
8	011778004	17 中建材 SCP006	200,000	19,988,160.42	7.60
9	011698854	16 兖州煤 业 SCP007	200,000	19,974,992.58	7.59
10	111710226	17 兴业银 行 CD226	200,000	19,917,321.29	7.57

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

7.7 “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	—
报告期内偏离度的最高值	0.1971%
报告期内偏离度的最低值	0.0301%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0836%

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：报告期内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

注：本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

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	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,460,101.22
4	应收申购款	457,764.22
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,917,865.44

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额	持有人	户均持有的基	持有人结构
----	-----	--------	-------

级别	户数 (户)	金份额	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	6,574	29,448.38	3,592,235.73	1.86%	190,001,399.67	98.14%
国开货币 B	5	13,891,616.71	58,831,318.19	84.70%	10,626,765.36	15.30%
合计	6,579	39,983.54	62,423,553.92	23.73%	200,628,165.03	76.27%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国开货币 A	256,921.85	0.1327%
	国开货币 B	—	—
	合计	256,921.85	0.0979%

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

§ 9 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	3,050,089,390.02	1,284,021,089.15

份额总额		
本报告期期初基金份额总额	188,884,267.13	479,161,777.76
本报告期基金总申购份额	548,210,737.84	436,949,006.36
减:本报告期基金总赎回份额	543,501,369.57	846,652,700.57
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	193,593,635.40	69,458,083.55

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

经国开泰富基金管理有限责任公司第二届董事会第一次(临时)会议审议通过, 郑文杰同志自 2016 年 7 月 18 日起任国开泰富基金管理有限责任公司董事长, 至第二届董事会任期届满日止。在郑文杰先生任职事项根据证监会要求完成备案或报告手续之前, 董事长职责暂由公司总经理李鑫先生代为履行。在本报告报出之日前公司已完成高管人员报备事宜, 董事长郑文杰先生于 2017 年 1 月 6 日起已正常履职。上述事项已报监管部门备案。

基金托管人的基金托管部门的重大人事变动: 本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本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。

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	
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重投资研究服务质量

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 确定券商范围：券商的选择由公司分管投资的经理层人员及投资部、专户投资部、交易部、研究部、监察稽核部负责人组成的办公会议集体讨论拟合作券商名单。

b) 初始评分确定合作名单：由研究部、投资部、专户投资部、交易部对拟合作券商进行评分，根据评分结果确定合作券商，报公司总经理办公会审批。

c) 交易量分配：投资部、研究部、专户投资部、交易部根据券商提供的研究报告质量和综合研究服务的情况，于每季前三个工作日分别对券商进行评分。交易部将评分结果进行汇总，形成最终评分结果，作为当季分配交易量的依据。公司严禁将席位开设与券商的基金销售挂钩，严禁以任何形式向券商承诺基金在席位上的交易量。

d) 日常监控：公司监察稽核部、交易部、风险管理部、基金运营部、研究部等相关部门均可从各自业务角度对合作券商进行监控，当合作券商发生可能导致基金持有人利益受损的事件时，各部门均可提请暂停与该券商经纪业务的合作，经公司监察稽核部、交易部、风险管理部、基金运

营部、研究部会商后执行。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 投资部、研究部、专户投资部、交易部根据证券公司提供的研究报告质量和综合研究服务的情况，于每季前三个工作日分别对证券公司进行评分。交易部将投资部、研究部、专户投资部、交易部对证券公司的评分结果进行汇总，形成最终评分结果，作为当季分配交易量的依据。交易部于每季初根据最新评分结果，与累计席位交易量进行比较，拟定席位使用调整计划，填写《券商交易席位分配表》。经公司领导审批后执行。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

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
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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%。

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		区间					
机 构	1	2017-01-01 至 2017-06-30	200,000,000.00	1,213,683.40	201,213,683.40	0.00	0.00%
个 人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金为货币型基金，风险等级为低级，单一投资者持有的份额比例过于集中达到或超过 20%，存在潜在流动性风险和集中赎回风险。但公司对该基金拥有完全自主投资决策权，报告期间严格按照法规和基金合同规定合规运作，严控流动性风险，单一投资者赎回本基金不会给本基金带来显著的流动性风险。因基金单位净值最末位小数致四舍五入的原因，单一投资者赎回本基金可能给存续投资者带来一定程度的净值损失。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2017 年 1 月 6 日，郑文杰先生正式任职公司董事长职务。公司于 2017 年 2 月 6 日完成公司法定代表人工商变更。

2017 年 3 月 27 日，王婷婷增聘为国开泰富岁月鎏金定期开放信用债券型证券投资基金及国开泰富货币市场证券投资基金基金经理。

国开泰富基金管理有限责任公司

2017 年 8 月 25 日