

# 国开泰富货币市场证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 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 2015 年 8 月 21 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 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 债券回购融资情况.....	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.5 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.....	38
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
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.....	39
7.8 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40

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 .....	40
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
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 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	43
10.9 其他重大事件.....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>44</b>
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## § 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	152,480,599.92 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	84,912,662.54 份	67,567,937.38 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 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	刘士余

## 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国开泰富基金管理有限责任公司	北京市东城区朝阳门北大街 7 号五矿广场 C 座 10 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

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( 2015 年 1 月 14 日 - 2015 年 6 月 30 日 )	报告期( 2015 年 1 月 14 日 - 2015 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	10,269,170.57	3,831,274.77
本期利润	10,269,170.57	3,831,274.77
本期净值收益率	1.7073%	1.8216%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	84,912,662.54	67,567,937.38
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	1.7073%	1.8216%

### 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	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④
----	--------------	--------------	--------------	----------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去一个月	0.1807%	0.0106%	0.1110%	0.0000%	0.0697%	0.0106%
过去三个月	0.8132%	0.0103%	0.3366%	0.0000%	0.4766%	0.0103%
自基金合同生效起至今	1.7073%	0.0112%	0.6214%	0.0000%	1.0859%	0.0112%

## 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	0.2006%	0.0106%	0.1110%	0.0000%	0.0896%	0.0106%
过去三个月	0.8742%	0.0103%	0.3366%	0.0000%	0.5376%	0.0103%
自基金合同生效起至今	1.8216%	0.0112%	0.6214%	0.0000%	1.2002%	0.0112%

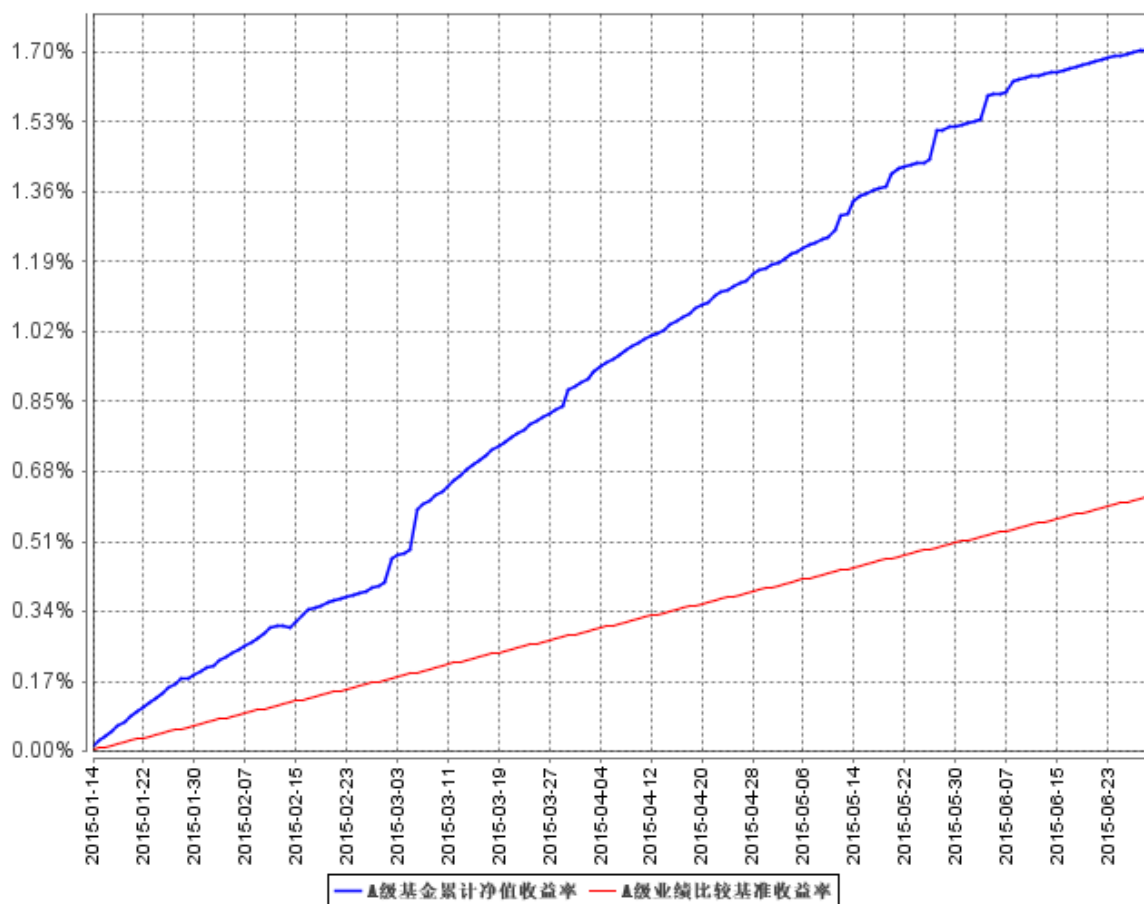
注：1、本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）；

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；

3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内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，本报告期处于建仓期内。

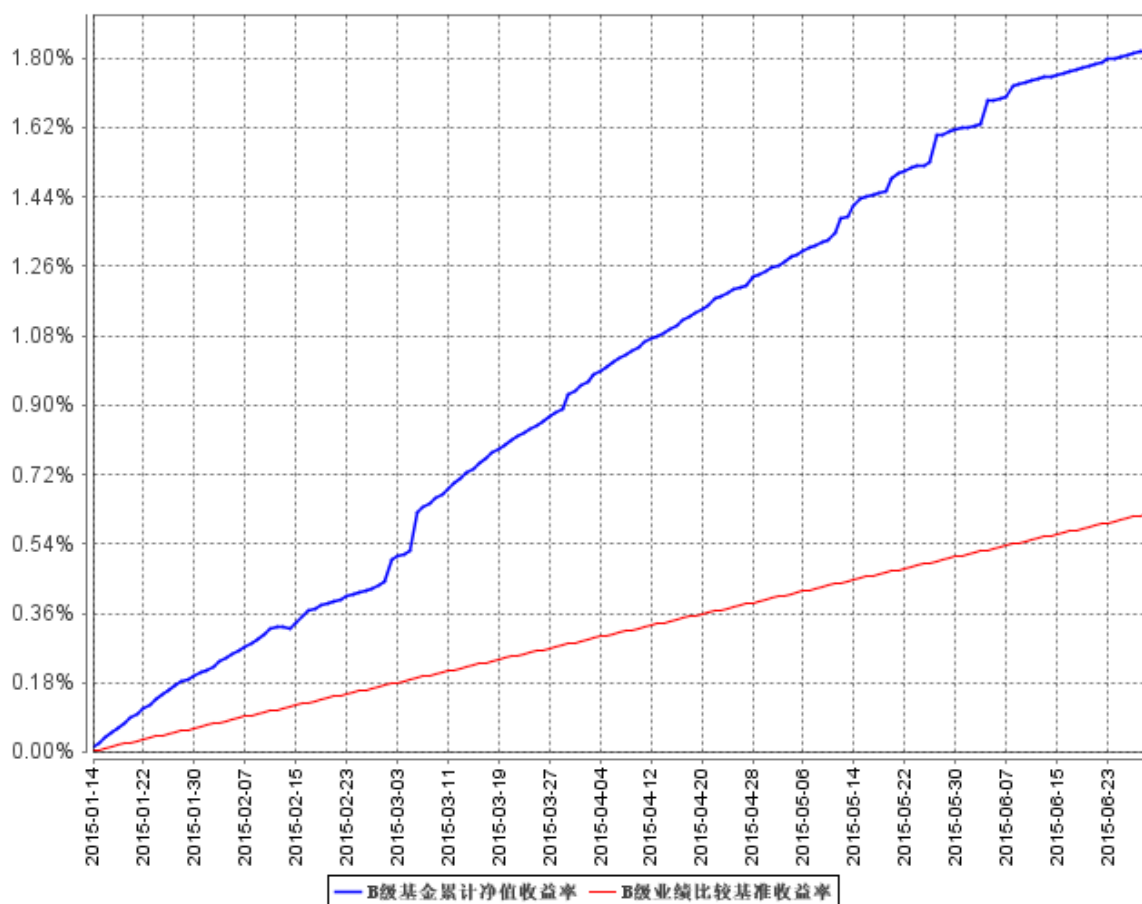
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**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；

3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内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，本报告期处于建仓期内。

### 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 2015 年 6 月 30 日，公司旗下管理 2 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。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	-	2 年	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

上半年，宏观经济下行压力偏大，制造业 PMI 指数、工业增加值等宏观经济指标低位徘徊，近期虽微弱回升，但跟踪的水泥价格、铁路货运量、发电量等高频数据表现不佳，暗示宏观经济依然疲弱，稳增长压力丝毫不减。货币政策延续了去年以来的宽松基调，相继实施了降准、降息等举措，同时将公开市场回购操作利率持续下调，其中，7 天逆回购利率自年初的 3.85% 下调至 2.50%，一方面消除了之前阻挡中长端利率下行的障碍，另一方面，也有意维持货币市场宽松、平稳的低利率环境。受持续宽松政策及银行非标萎缩的影响，货币市场利率大幅下降，其中，银行间隔夜及 7 天回购加权利率一度回落至 1.0% 及 2.0% 附近，后期虽有所回升，但仍属于偏低的水平。

本基金前期运作过程中，始终高度重视流动性、安全性和收益性三者之间的平衡，保持了较高的银行存款配置比例，把握住了去年年底以来股市向好、IPO 月度发行密集的有利时机，在交易所和银行间市场获取了较高的资金拆放收益，并利用债市收益率上行阶段的良好配置时点择机持仓部分现券头寸，整体组合稳健而富有弹性。进入 2015 年二季度，货币市场“宽资金、低利率”特征越来越明显，本基金为重点化解资金的再投资压力，在平衡流动性的基础上，大幅度提高了短期债券的配置比例，锁定收益，同时适度杠杆，获取债券与货币市场的息差收益，实现了良好

的投资回报。

#### 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 1.7073%，国开货币 B 净值增长率 1.8216%，业绩比较基准收益率为 0.6214%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年世界经济形势风云突变，在美国经济缓慢复苏、欧洲经济有所改善和日本经济持续疲弱的背景下，中国经济承受较大的下行压力。外部需求乏力，内部需求不佳，房地产投资跟传统制造业增速有所回落，使得投资及消费两驾马车同时刹车，而进出口也起伏不定，促使宏观调控政策在“保持稳增长、促改革、调结构、惠民生”中更偏向“保增长”，短期内通过地方债务置换与松绑平台发债限制，加大基础设施投资和刺激国内消费需求，以积极的财政政策增加公共支出，以稳健的货币政策疏通货币政策向实体经济的传导路径，自 2014 年 11 月以来，中国进入降息、降准周期，货币政策将继续保持相对宽松，为实体经济服务。

上半年，中国 GDP 数据在一、二季度均同比增长 7%，符合政府 2015 年工作目标。从总体物价水平来看，GDP 平减指数从 2015 年一季度的-1.1%回升至 2015 年二季度的 0.1%，表明总体物价水平有所回升，通缩状况有所缓解。分产业来看，第二产业加速下滑，由一季度的 6.4%下降至 5.8%；但第三产业改善明显，从一季度的 7.9%升至 8.9%，而第三产业的增速与二季度繁荣的金融市场以及房地产市场销售回暖有关。6 月份工业增加值同比增速为 6.8%，比 5 月份有所好转，提升 0.7 个百分点，工业增速回升表明在宽松的财政政策及稳健的货币政策下，经济存在边际改善的可能性。但该数据与高频跟踪的铁路货运量、发电量、水泥价格等数据有一定的背离，结合当前大宗商品价格低位徘徊、PPI 持续负增长、产能过剩和企业去杠杆令制造业投资持续低迷，尽管下半年中国经济在各项稳增长措施下低位趋稳的可能性加大，但难言乐观与复苏。特别需要关注的是，自 6 月中下旬以来，股市快速大幅下跌令市场始料未及，虽然在各部委“组合拳”下暂时趋稳，但其造成的“财富幻觉”破灭对后续消费领域以及对部分依赖股市融资的企业所带来的资金压力的负反馈仍值得高度关注，并将在一定程度上拖累经济。

自 2014 年 11 月起至 2015 年 6 月底，央行已宣布四次降息、两次降准，一年贷款基准利率已降至 4.85%，是新中国成立以来历史最低值，但实体经济“融资难、融资贵”的问题并没有显著解决，从“宽货币”到“宽信用”的传导路径仍存在障碍，如何进一步降低中长端利率，仍是政策需要迫切解决的问题。考虑到稳增长压力、外汇占款投放减少、稳定股市、实体经济融资成本依然高昂等情况，2015 年下半年货币政策宽松的基调不会改变。与此同时，6 月份的股市巨幅

波动，也令股市相关制度建设与改革加速，如杠杆交易的风险控制、新股发行方式等。祸兮福所倚，福兮祸所伏，此举无疑将减少长期支撑“无风险、高收益”的“神话资产”，利于中长端利率的下行。而此次股市鲜活的风险教育，令资金重新审视风险收益比，债券类资产也有望在资金再配置中获得相当程度的青睐，而追逐绝对收益及债市再杠杆的过程，令信用利差存在持续压缩的可能。

不断超于预期的地方债务置换进度与额度，在降低存量城投债信用风险的同时，也拉长了银行体系资产端的整体久期，一定程度上挤压了机构正常的中长期债券配置需求；美联储年内加息预期越来越强，美债利率的回升不断挤压中美利差，也进一步缩小了国内政策放松的空间；今年 2 月份以来“猪周期”的启动，给未来物价走势带来上行压力。整体来看，在利好与利空的对垒中，利率类债券“上有顶、下有底”，横盘窄幅振荡、中枢水平略有下行的可能性较高。而“宽资金、低利率”的货币环境，在加大货币资产再投资压力的同时，也将进一步压低货币资产的整体回报。

#### 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 4 人，分别是公司基金运营部负责人、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遵规守信情况声明

2015 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 托管人对本半年度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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	480,143.36
结算备付金		160,335.00
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	170,423,089.25
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		170,423,089.25
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	3,606,315.75
应收股利		-
应收申购款		30,000.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		174,699,883.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		21,899,789.05
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		48,894.01
应付托管费		14,816.41
应付销售服务费		22,406.83
应付交易费用	6.4.7.7	41,966.71
应交税费		-
应付利息		1,410.95

应付利润		4,959.77
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	185,039.71
负债合计		22,219,283.44
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	152,480,599.92
未分配利润	6.4.7.10	-
所有者权益合计		152,480,599.92
负债和所有者权益总计		174,699,883.36

注：1. 报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 152,480,599.92 份，其中国开货币 A 份额基金净值 1.0000 元，基金份额总额 84,912,662.54 份；国开货币 B 份额基金净值 1.0000 元，基金份额总额 67,567,937.38 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 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：2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		16,560,348.89
1.利息收入		15,533,848.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,311,710.20
债券利息收入		1,129,047.86
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,093,090.79
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,021,500.04
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	1,021,500.04
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
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	5,000.00
<b>减：二、费用</b>		2,459,903.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,166,493.76



2. 托管费	6.4.10.2.2	353,482.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	661,710.95
4. 交易费用	6.4.7.19	-
5. 利息支出		55,774.74
其中：卖出回购金融资产支出		55,774.74
6. 其他费用	6.4.7.20	222,441.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>14,100,445.34</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>14,100,445.34</b>

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 1 月 4 日。

### 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：2015 年 1 月 14 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 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）	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）	-	14,100,445.34	14,100,445.34
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）	-4,181,629,879.25	-	-4,181,629,879.25
其中：1. 基金申购款	510,347,412.58	-	510,347,412.58
2. 基金赎回款	-4,691,977,291.83	-	-4,691,977,291.83
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）	-	-14,100,445.34	-14,100,445.34
五、期末所有者权益（基金净值）	152,480,599.92	-	152,480,599.92

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：

_____ 王翀 _____	_____ 张智 _____	_____ 姚劼 _____
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]1145 号《关于准予国开泰富货币市场证券投资基金基金注册

的批复》的批准，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 号验资报告予以验证。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。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、招募说明书、托管协议》的有关规定，本基金分设两类基金份额：A 类基金份额首次认/申购金额不得低于人民币 100 元，追加认/申购金额不得低于人民币 100 元，并按照 0.25%年费率计提销售服务费；B 类基金份额首次认/申购金额不得低于人民币 500 万元，追加认/申购金额不得低于人民币 100 元，并按照 0.01%年费率计提销售服务费。

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，本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，具体如下：1、现金；2、通知存款；3、短期融资券；4、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；5、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据；6、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；7、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）；8、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；9、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金融工具。未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的，基金管理人在履行适当程序后，本基金可参与同业存单的投资，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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》和中国证监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 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 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。

#### 6.4.4.1 会计年度

本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 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和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 6.4.4.4 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。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了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，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金的基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金的基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 6.4.4.9 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后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；
2. 本基金收益分配方式为红利再投资，

免收再投资的费用；3. “每日分配、按月支付”。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。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；4. 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；5. 本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人全部赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；6. 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；7. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。在不违背法律法规及监管机构的规定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据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，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：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债

登记结算有限责任公司独立提供。

## 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(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 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	480,143.36
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	480,143.36

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2015年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	170,423,089.25	170,985,000.00	561,910.75	0.3685%
	合计	170,423,089.25	170,985,000.00	561,910.75	0.3685%

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末各项买入返售金融资产无期末余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	93.16
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	72.20
应收债券利息	3,606,150.39
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	3,606,315.75



**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	24,161.55
银行间市场应付交易费用	17,805.16
合计	41,966.71

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费用	38,062.64
预提信息披露费	137,977.07
预提银行间帐户维护费	9,000.00
合计	185,039.71

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

国开货币 A		
项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	3,050,089,390.02	3,050,089,390.02
本期申购	186,571,123.72	186,571,123.72
本期赎回(以“-”号填列)	-3,151,747,851.20	-3,151,747,851.20
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	84,912,662.54	84,912,662.54

金额单位：人民币元

国开货币 B
--------

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,284,021,089.15	1,284,021,089.15
本期申购	323,776,288.86	323,776,288.86
本期赎回(以“-”号填列)	-1,540,229,440.63	-1,540,229,440.63
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	67,567,937.38	67,567,937.38

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国开货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	10,269,170.57	-	10,269,170.57
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-10,269,170.57	-	-10,269,170.57
本期末	-	-	-

单位：人民币元

国开货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,831,274.77	-	3,831,274.77
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,831,274.77	-	-3,831,274.77
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	活期存款利息收入	212,199.38
定期存款利息收入	12,080,052.29	

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,458.53
其他	-
合计	12,311,710.20

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期末未投资股票。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	560,708,022.66
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	544,323,009.86
减:应收利息总额	15,363,512.76
买卖债券差价收入	1,021,500.04

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未投资贵金属。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖收益权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
基金赎回费收入	-
配债手续费收入	5,000.00
合计	5,000.00

**6.4.7.19 交易费用**

本基金本报告期内无交易费用。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月14日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
审计费用	38,062.64
信息披露费	137,977.07
银行汇划费用	33,911.43
其他费用	490.00
银行间账户维护费	12,000.00
合计	222,441.14

**6.4.7.21 分部报告**

无。

## 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

截至财务报表批准日，本基金无须做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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 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
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
北京国开泰富资产管理有限责任公司	基金管理人的子公司

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期未有通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.1 关联方报酬

##### 6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,166,493.76
其中:支付销售机构的客户维护费	663,180.92

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。

#### 6.4.10.1.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期
	2015年1月14日(基金合同生效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	353,482.96

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。

#### 6.4.10.1.3 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		
	2015年1月14日(基金合同生效日)至2015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
中国农业银行股份有限公司	648,720.41	7,433.20	656,153.61
国开泰富基金管理有限责任公司	1,130.45	1,777.60	2,908.05
国开证券有限责任公司	46.55	-	46.55
合计	649,897.41	9,210.80	659,108.21

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。

#### 6.4.10.2 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。

#### 6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.3.1 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 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 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	-	-
期间申购/买入总份额	-	35,000,000.00
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

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 2015 年 5 月 25 日通过直销申购国开货币 B 基金 3,000 万元人民币，申购费率为零；基金管理人于 2015 年 5 月 27 日通过在直销赎回国开货币 B 基金 500 万元人民币，赎回费率为零；基金管理人于 2015 年 5 月 28 日通过直销申购国开货币 B 基金 500 万元人民币，申购费率为零；基金管理人于 2015 年 6 月 10 日通过在直销赎回国开货币 B 基金 30,059,976.03 元人民币，赎回费率为零；截止 2015 年 6 月 30 日基金管理人未持有本基金。

##### 6.4.10.3.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未投资本基金。

#### 6.4.10.4 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 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	480,143.36	-

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。

#### 6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 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
10,266,673.98	-	2,496.59	10,269,170.57	-

##### 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
3,828,811.59	-	2,463.18	3,831,274.77	-

#### 6.4.12 期末（2015 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

本基金本报告期末未持有隐认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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 21,899,789.05 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
011537007	15 中建材 SCP007	2015 年 7 月 1 日	99.91	100,000	9,991,000.00
041458073	14 鄂供销 CP002	2015 年 7 月 1 日	101.07	100,000	10,107,000.00
041460072	14 夏商 CP001	2015 年 7 月 1 日	101.02	20,000	2,020,400.00
合计				220,000	22,118,400.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

#### 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

本基金管理人建立了由风险控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理部门在识别、计量投资风险后,通过正式报告的方式,将分析结果及时传达给基金经理、投资决策委员会和风险控制委员会,协助风险控制政策、风险应对策略的制定与实施。同时各业务条线、各部门,按照公司的风险管理总体目标、风险管理战略,制定与实施与公司整体风险承受能力相匹配的风险管理制度和相关风险应对措施、控制流程,并不断及时、准确、全面地将各部门或岗位的风险信息与监测情况向相关部门负责人和风险管理部门报告,确保风险管理工作覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。

本基金在日常经营活动中涉及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,将风险控制在公司可承受的范围内。

##### 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债券发行人信用评级降低导致债券价格下降以及发行人出现违约、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。

本基金管理人建立了内部评级体系和债券库、交易对手库管理制度,对发行人及所投资债券进行内部评级,设定风险限额,对交易对手的资信状况进行充分评估,以控制可能出现的信用风险。

**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 2015 年 6 月 30 日
A-1	130,380,746.07
A-1 以下	-
未评级	29,990,637.93
合计	160,371,384.00

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

**6.4.13.2.2 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 2015 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	10,051,705.25
合计	10,051,705.25

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所投资的证券集中在证券交易所或银行间市场交易，均能以合理价格适时变现。

**6.4.13.4 市场风险**

市场风险指因受各种因素影响而引起的证券及其衍生品市场价格不利波动，使投资组合资产、公司资产面临损失的风险。

**6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的所投资证券市场价格或现金流量等，所受市场利率变动而发生波动的风险。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 2015年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	480,143.36	-	-	-	-	-	480,143.36
结算备付金	160,335.00	-	-	-	-	-	160,335.00
交易性金融资产	20,026,262.83	90,281,804.43	60,115,021.99	-	-	-	170,423,089.25
应收利息	-	-	-	-	-	3,606,315.75	3,606,315.75
应收申购款	-	-	-	-	-	30,000.00	30,000.00
资产总计	20,666,741.19	90,281,804.43	60,115,021.99	-	-	3,636,315.75	174,699,883.36
负债							
卖出回购金融资产款	21,899,789.05	-	-	-	-	-	21,899,789.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	48,894.01	48,894.01
应付托管费	-	-	-	-	-	14,816.41	14,816.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,406.83	22,406.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	41,966.71	41,966.71
应付利息	-	-	-	-	-	1,410.95	1,410.95
应付利润	-	-	-	-	-	4,959.77	4,959.77
其他负债	-	-	-	-	-	185,039.71	185,039.71
负债总计	21,899,789.05	-	-	-	-	319,494.39	22,219,283.44
利率敏感度缺口	-1,233,047.86	90,281,804.43	60,115,021.99	-	-	-3,316,821.36	152,480,599.92

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，在影子价格监控机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会发生重大变动。

## 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，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。本基金投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	170,985,000.00	112.14
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	170,985,000.00	112.14

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

无。

**6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

无。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	170,423,089.25	97.55
	其中：债券	170,423,089.25	97.55
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	640,478.36	0.37
4	其他各项资产	3,636,315.75	2.08
5	合计	174,699,883.36	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		2.40
	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	21,899,789.05	14.36
	其中：买断式回购融资	-	-

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

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

## 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余限未超过 180 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	13.55	14.36
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	26.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

3	60 天(含)—90 天	32.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	26.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	13.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		112.19	14.36

#### 7.4 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	10,051,705.25	6.59
	其中：政策性金融债	10,051,705.25	6.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	160,371,384.00	105.17
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	170,423,089.25	111.77
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.5 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	041458073	14 鄂供销 CP002	100,000	10,095,927.95	6.62
2	041471007	14 蚌埠玻璃 CP001	100,000	10,080,902.91	6.61
3	041460088	14 厦港务发 CP001	100,000	10,054,807.82	6.59
4	041466028	14 鄂长投 CP002	100,000	10,054,652.74	6.59
5	130420	13 农发 20	100,000	10,051,705.25	6.59
6	041464052	14 粤合 CP001	100,000	10,051,500.61	6.59
7	041460072	14 夏商 CP001	100,000	10,031,568.37	6.58
8	041471005	14 万联能源 CP001	100,000	10,013,463.60	6.57
9	071543003	15 金元证券 CP003	100,000	10,012,799.23	6.57
10	071544002	15 华福证券 CP002	100,000	10,000,076.71	6.56

## 7.6 “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	30
报告期内偏离度的最高值	0.4800%
报告期内偏离度的最低值	0.0004%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1582%

注：表内各项数据均按报告期的交易日统计。

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 投资组合报告附注

**7.8.1** 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 1.0000 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。

**7.8.2** 报告期内，本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，其摊余成本总计在每个交易日均未超过当日基金资产净值的 20%。

**7.8.3** 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。

## 7.8.4 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	3,606,315.75
4	应收申购款	30,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,636,315.75

## 7.8.5 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	1,282	66,234.53	2,313,707.54	2.72%	82,598,955.00	97.28%
国开货币 B	6	11,261,322.90	62,558,293.09	92.59%	5,009,644.29	7.41%
合计	1,288	118,385.56	64,872,000.63	42.54%	87,608,599.29	57.46%

### 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	1,309.38	0.0009%
	国开货币 B	-	-
	合计	1,309.38	0.0009%

### 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
	国开货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国开货币 A	0
	国开货币 B	0
	合计	0

## § 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）基金份额总额	3,050,089,390.02	1,284,021,089.15
本报告期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	186,571,123.72	323,776,288.86
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,151,747,851.20	1,540,229,440.63
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	84,912,662.54	67,567,937.38

## § 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

本报告期后，2015 年 7 月 10 日，经国开泰富基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）第一届董事会第十一次会议决定，王翀先生不再担任公司总经理一职。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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	-	-	24,161.55	100.00%	-

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	-	-	2,418,465,000.00	100.00%	-	-

### 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%。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国开泰富货币市场证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2015年1月15日
2	国开泰富货币市场证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2015年1月26日
3	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金申购业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2015年2月10日
4	国开泰富基金管理有限责任公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2015年3月30日
5	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金申购业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2015年3月31日
6	国开泰富货币市场证券投资基金	中国证券报、证券时报、上	2015年4月20

	金 2015 年第 1 季度报告	海证券报、公司网站	日
7	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2015年4月27日
8	关于开放国开泰富货币市场证券投资基金转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2015年5月21日
9	关于国开泰富基金增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构并实施费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2015年6月2日
10	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2015年6月16日

## § 11 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、中国证监会准予国开泰富货币市场证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》；
- 3、《国开泰富货币市场证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集注册国开泰富货币市场证券投资基金之法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地。

## 12.3 查阅方式

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人国开泰富基金管理有限责任公司。

客户服务中心电话：010-59363299

网址：[www.cdbsfund.com](http://www.cdbsfund.com)

国开泰富基金管理有限责任公司  
2015年8月28日