

# 国开泰富货币市场证券投资基金 2016 年年 度报告

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。

## 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、基金净值表现及利润分配情况</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.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 债券回购融资情况.....	44
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	44
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.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45

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 .....	46
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	46
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 .....	46
8.9 投资组合报告附注 .....	47
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
11.4 基金投资策略的改变 .....	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	50
11.9 其他重大事件 .....	50
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
13.1 备查文件目录 .....	54
13.2 存放地点 .....	55
13.3 查阅方式 .....	55

## § 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	林葛
	联系电话	010 5936 3088	010-66060069
	电子邮箱	xiaoqiang@cdbfund.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	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、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	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%

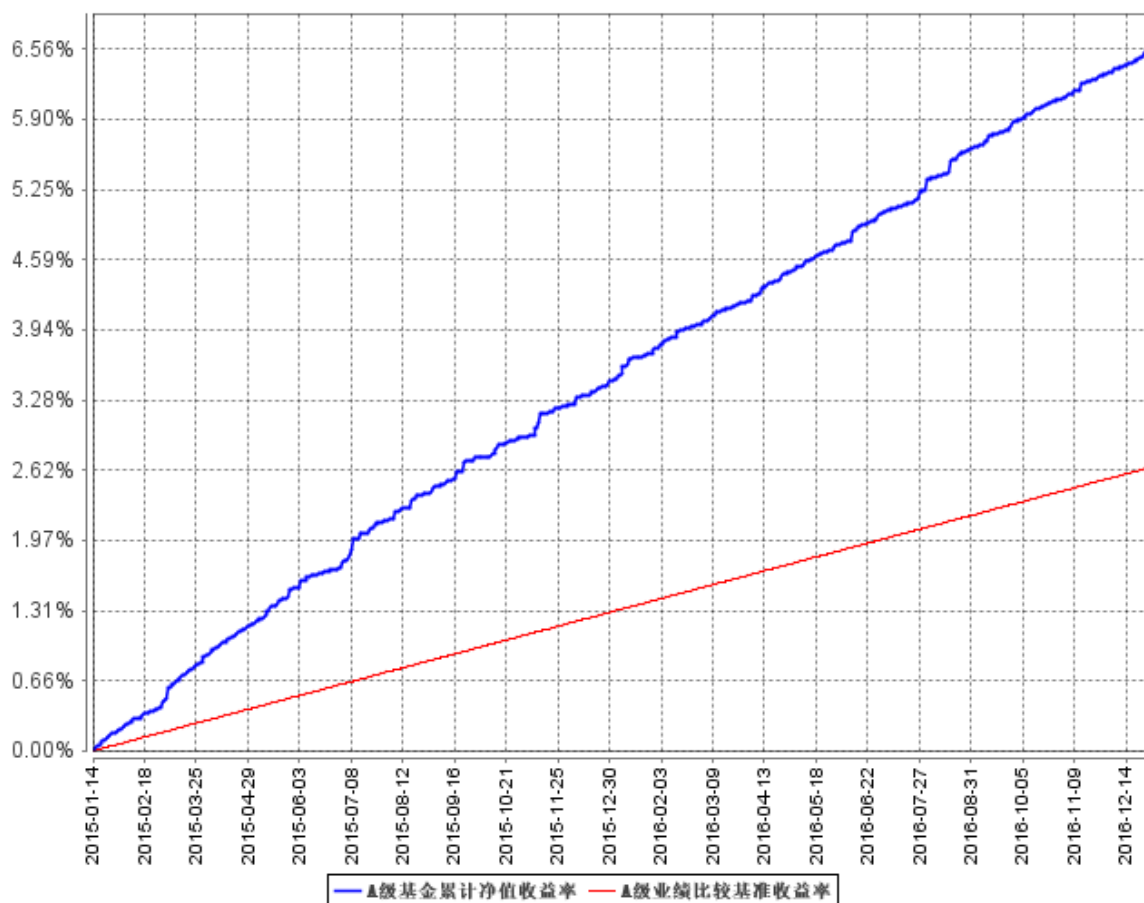
国开货币 B

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%

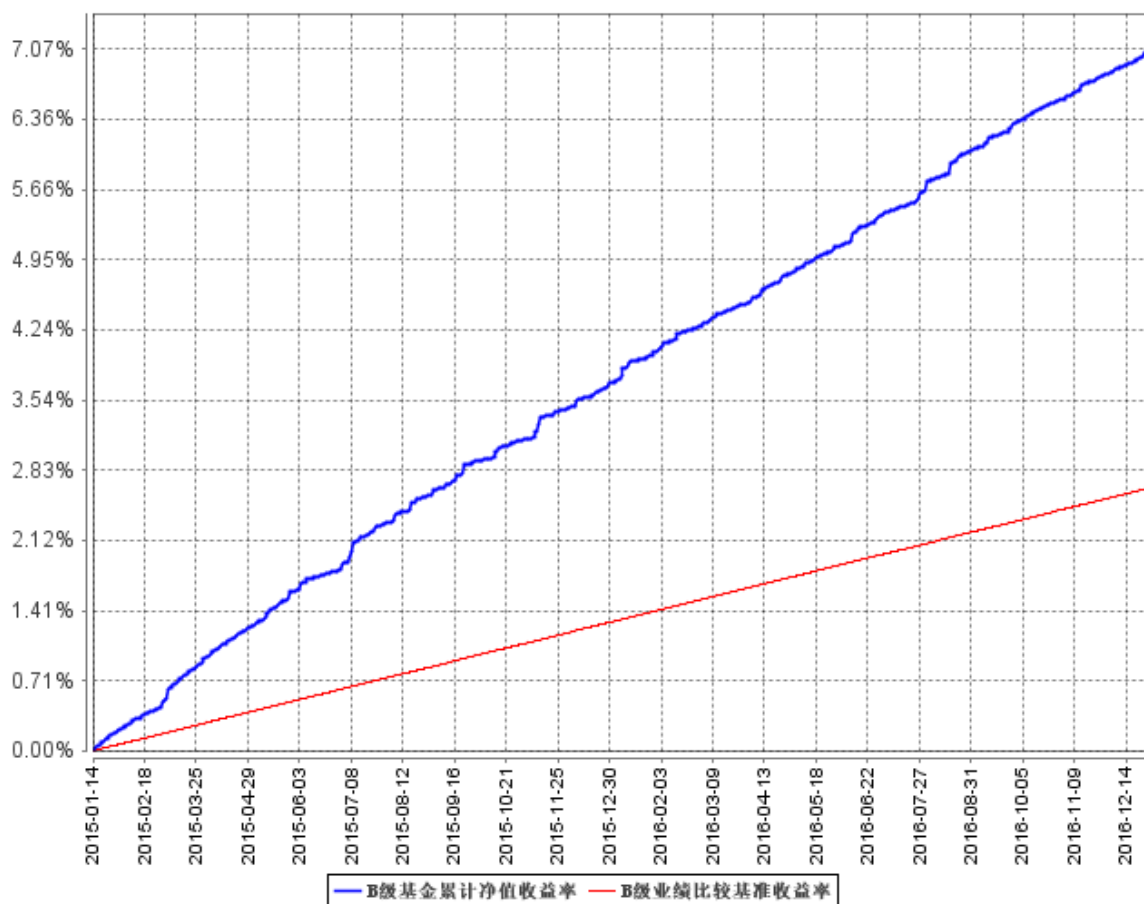
注：本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）。

### 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**



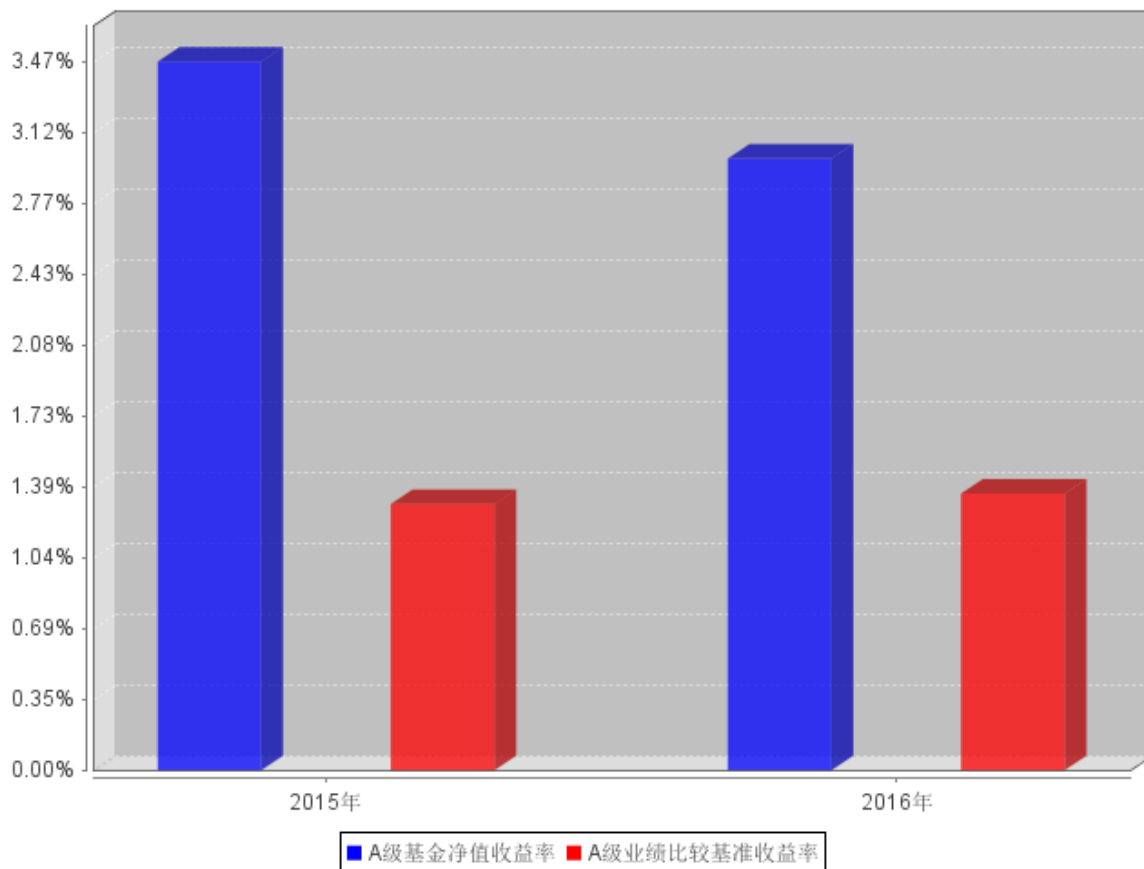
注：1、本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）；

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。

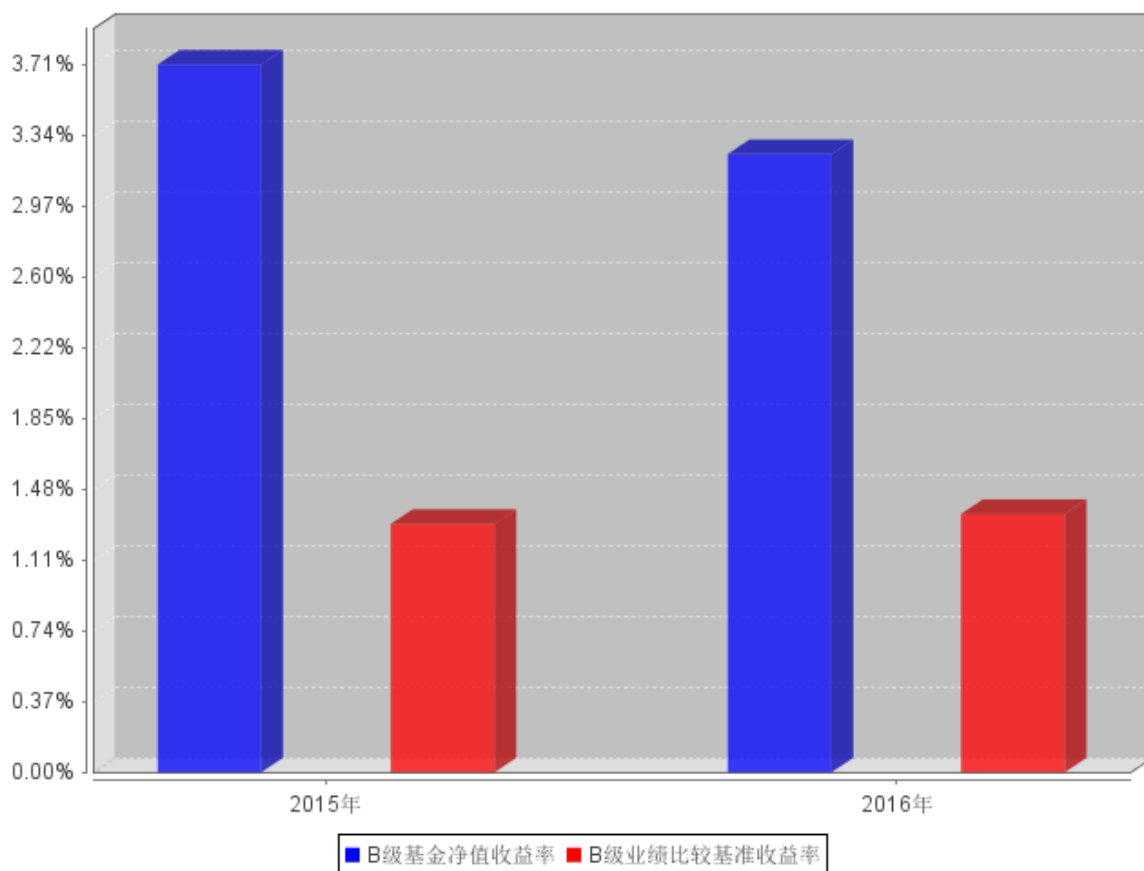


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**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，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，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。

### 4.3.3 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

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——被动抛债——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，中美利差收债、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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20329 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	国开泰富货币市场证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的国开泰富货币市场证券投资基金(以下简称“国开货币”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是国开泰富货币市场证券投资基金的基金管理人国开泰富基金管理有限责任公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述国开泰富货币市场证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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,公允反映了国开泰富货币市场证券投资基金 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。	
注册会计师的姓名	单峰	程红粤
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	

审计报告日期	2017 年 3 月 24 日
--------	-----------------

## § 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
<b>资产：</b>			
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
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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
<b>所有者权益：</b>			
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
<b>一、收入</b>		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“-”号填列）	7.4.7.18	-	5,000.00

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

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

## 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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表期间为 2015 年 1 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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



地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 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。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，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。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；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。

#### 7.4.4.11 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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。本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。

## 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

活期存款	3,516,406.70	182,095.53
定期存款	30,000,000.00	-
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	30,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计：	33,516,406.70	182,095.53

注：定期存款的存款期限指票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 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	418,596,483.96	418,829,000.00	232,516.04	0.0348%
	合计	418,596,483.96	418,829,000.00	232,516.04	0.0348%
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 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	251,249,626.94	252,112,000.00	862,373.06	0.3010%
	合计	251,249,626.94	252,112,000.00	862,373.06	0.3010%

注：

- 1、偏离金额=影子定价-摊余成本；
- 2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 7.4.7.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券_银行间	223,401,215.10	-
合计	223,401,215.10	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券_银行间	48,000,512.00	-
合计	48,000,512.00	-

#### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	178.30	90.17
应收定期存款利息	22,000.02	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	5,687,622.00	7,386,348.85
应收买入返售证券利息	277,464.29	50,103.98
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	5,987,264.61	7,436,543.00

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 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	30,647.74	24,959.18
合计	30,647.74	49,120.73

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	359,000.00	359,000.00
合计	359,000.00	359,000.00

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

国开货币 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,629,315.89	94,629,315.89
本期申购	1,040,295,452.29	1,040,295,452.29
本期赎回(以“-”号填列)	-946,040,501.05	-946,040,501.05
- 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	188,884,267.13	188,884,267.13

金额单位：人民币元

国开货币 B		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	191,859,141.61	191,859,141.61
本期申购	2,966,065,740.55	2,966,065,740.55
本期赎回(以“-”号填列)	-2,678,763,104.40	-2,678,763,104.40
- 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	479,161,777.76	479,161,777.76

注：本期申购含红利再投、转换入份额；本期赎回含转换出份额。

**7.4.7.10 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
上年度末	-	-	-
本期利润	4,430,860.45	-	4,430,860.45
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	-4,430,860.45	-	-4,430,860.45
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
上年度末	-	-	-
本期利润	10,416,537.65	-	10,416,537.65
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	-10,416,537.65	-	-10,416,537.65
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	4,089.58	218,636.80
定期存款利息收入	629,972.24	12,080,052.29
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	19,689.43
其他	-	-
合计	634,061.82	12,318,378.52

注：于 2016 年度，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况 (2015 年度：同)。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期末投资股票。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券(、债 转股及债券到期兑付)差价收入	1,432,453.81	2,924,986.00
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	1,432,453.81	2,924,986.00

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出债券(、债转股及债券到期兑 付)成交总额	1,945,126,278.78	1,368,331,844.87
减：卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成本总额	1,907,855,442.38	1,335,633,534.57
减：应收利息总额	35,838,382.59	29,773,324.30
买卖债券差价收入	1,432,453.81	2,924,986.00

#### 7.4.7.13.3 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。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 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。

##### 7.4.7.15.2 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。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 7.4.7.17 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。



### 7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	-	-
配债手续费收入	-	5,000.00
合计	-	5,000.00

### 7.4.7.19 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

### 7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	290,000.00	290,000.00
其他费用	1,741.00	1,120.00
银行汇划费用	49,304.04	52,569.65
银行间账户维护费	36,000.00	30,000.00
合计	437,045.04	433,689.65

### 7.4.7.21 分部报告

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须做披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)，要求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，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。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。

#### 7.4.9 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

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 × 0.33% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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 X 0.10%/当年天数。

### 7.4.10.2.3 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 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 X 约定年费率 / 当年天数。

### 7.4.10.3 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。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

### 7.4.10.5 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。

### 7.4.10.6 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。

### 7.4.10.7 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。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 7.4.11.1 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
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	-

### 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 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因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

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。本基金投资的金融工具主要包括现金、通知存款、短期融资券等。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。

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。

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括现金、通知存款、短期融资券等。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。

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。

### 7.4.13.2 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行 农业银行，定期存款存放在具有基金托管资格的股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；在交易所进行的交易均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，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具，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。

#### 7.4.13.2.1 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	110,251,238.97	211,176,631.36
A-1 以下	-	-
未评级	278,242,782.16	20,036,249.25
合计	388,494,021.13	231,212,880.61

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。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、政策性金融债及央行票据以外的按长期信用评级的债券投资（2015 年 12 月 31 日：本基金未持有按长期信用评级的债券投资）。

#### 7.4.13.3 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金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（企业债或短期融资券）来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2016 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 20,994,768.51 元将在一个月以内到



期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的全部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(所有者权益)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。

### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控,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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2016年12月31 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	33,516,406.70	-	-	-	33,516,406.70
交易性金融资产	339,031,265.98	79,565,217.98	-	-	418,596,483.96
买入返售金融资产	223,401,215.10	-	-	-	223,401,215.10
应收利息	-	-	-	5,987,264.61	5,987,264.61
应收申购款	-	-	-	8,288,216.91	8,288,216.91
资产总计	595,948,887.78	79,565,217.98	-	14,275,481.52	689,789,587.28
负债					
卖出回购金融资产款	20,994,768.51	-	-	-	20,994,768.51
应付管理人报酬	-	-	-	167,285.62	167,285.62
应付托管费	-	-	-	50,692.58	50,692.58
应付销售服务费	-	-	-	47,027.40	47,027.40

应付交易费用	-	-	-	30,647.74	30,647.74
应付利息	-	-	-	3,589.98	3,589.98
应付利润	-	-	-	90,530.56	90,530.56
其他负债	-	-	-	359,000.00	359,000.00
负债总计	20,994,768.51	-	-	748,773.88	21,743,542.39
利率敏感度缺口	574,954,119.27	79,565,217.98	-	13,526,707.64	668,046,044.89
上年度末 2015年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	182,095.53	-	-	-	182,095.53
交易性金融资产	241,236,338.14	10,013,288.80	-	-	251,249,626.94
买入返售金融资产	48,000,512.00	-	-	-	48,000,512.00
应收利息	-	-	-	7,436,543.00	7,436,543.00
应收申购款	-	-	-	164,200.00	164,200.00
资产总计	289,418,945.67	10,013,288.80	-	7,600,743.00	307,032,977.47
负债					
卖出回购金融资产款	19,999,790.00	-	-	-	19,999,790.00
应付管理人报酬	-	-	-	78,371.76	78,371.76
应付托管费	-	-	-	23,749.00	23,749.00
应付销售服务费	-	-	-	23,774.32	23,774.32
应付交易费用	-	-	-	49,120.73	49,120.73
应付利息	-	-	-	1,148.39	1,148.39
应付利润	-	-	-	9,565.77	9,565.77
其他负债	-	-	-	359,000.00	359,000.00
负债总计	19,999,790.00	-	-	544,729.97	20,544,519.97
利率敏感度缺口	269,419,155.67	10,013,288.80	-	7,056,013.03	286,488,457.50

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

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.14 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 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 418,596,483.96 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 251,249,626.94 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

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	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%。

## 11.9 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	国开泰富基金管理有限责任公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所及中国金融期货交易所指数发生不可恢复熔断的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	关于 2016 年 1 月 7 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 7 日
3	国开泰富货币市场证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 20 日
4	国开泰富基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 22 日
5	关于国开泰富基金增加大泰金石投资管理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	2016 年 1 月 29 日
6	关于国开泰富基金增加上海汇付金融服务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	2016 年 1 月 29 日

7	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 2 月 1 日
8	国开泰富货币市场证券投资基金更新招募说明书(2016 年第 1 号)	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 2 月 29 日
9	关于国开泰富货币市场证券投资基金增加销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 17 日
10	关于国开泰富基金增加上海联泰资产管理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	2016 年 3 月 17 日
11	国开泰富货币市场证券投资基金 2015 年年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 28 日
12	国开泰富货币市场证券投资基金 2015 年年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 28 日
13	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 28 日
14	国开泰富基金关于直销网上交易天天盈客户费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 29 日
15	国开泰富货币市场证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 21 日
16	关于国开泰富基金参加深圳新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 21 日
17	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 25 日
18	关于国开泰富基金增加上海好	中国证券报、证券时报、上	2016 年 6 月 1

	买基金销售有限公司为销售机构并实施费率优惠的公告	海证券报、公司网站	日
19	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016年6月2日
20	国开泰富基金关于调整旗下开放式基金在好买基金申购金额下限的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016年6月15日
21	国开泰富基金管理有限责任公司严正声明	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016年7月14日
22	国开泰富货币市场证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016年7月20日
23	国开泰富基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016年7月22日
24	关于修改国开泰富货币市场证券投资基金基金合同及托管协议的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016年7月28日
25	国开泰富基金管理有限责任公司国开泰富货币市场证券投资基金基金合同	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016年7月28日
26	国开泰富基金管理有限责任公司国开泰富货币市场证券投资基金托管协议	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016年7月28日
27	关于国开泰富基金增加北京汇成基金销售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	2016年8月24日
28	国开泰富货币市场证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016年8月25日

29	国开泰富货币市场证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 25 日
30	国开泰富货币市场证券投资基金更新招募说明书(2016 年第 2 号)	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 25 日
31	国开泰富货币市场证券投资基金更新招募说明书(摘要)(2016 年第 2 号)	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 25 日
32	关于国开泰富基金增加上海陆金所资产管理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	2016 年 8 月 29 日
33	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 9 日
34	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 26 日
35	国开泰富基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 27 日
36	关于国开泰富基金增加北京晟视天下投资管理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	2016 年 10 月 21 日
37	国开泰富货币市场证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 24 日
38	关于国开泰富基金管理有限责任公司直销网上交易系统升级暂停交易的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 14 日
39	关于国开泰富基金管理有限责	中国证券报、证券时报、上	2016 年 11 月

	任公司直销网上交易系统升级 暂停交易的公告	海证券报、公司网站	17 日
40	关于国开泰富基金参加交通银行手机银行费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 30 日
41	关于国开泰富基金直销网上交易增加银联渠道并进行费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 6 日
42	国开泰富基金关于开展基金直销柜台申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 7 日
43	关于国开泰富基金参加交通银行手机银行费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 24 日
44	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 26 日
45	关于国开泰富基金增加浙商银行股份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	2016 年 12 月 27 日
46	关于国开泰富基金参与农业银行网上银行手机银行申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地。

### 13.3 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  
2017年3月28日