

国开泰富货币市场证券投资基金 2017 年半年度报告

2017-06-30

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

报告送出日期：2017-08-25

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

[重要提示](#)

[基金简介](#)

[基金基本情况](#)

[基金产品说明](#)

[基金管理人和基金托管人](#)

[信息披露方式](#)

[其他相关资料](#)

[主要财务指标和基金净值表现](#)

[主要会计数据和财务指标](#)

[基金净值表现](#)

[基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较](#)

[自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较](#)

[管理人报告](#)

[基金管理人及基金经理情况](#)

[基金管理人及其管理基金的经验](#)

[基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介](#)

[管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明](#)

[管理人对报告期内公平交易情况的专项说明](#)

[公平交易制度的执行情况](#)

[异常交易行为的专项说明](#)

[管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明](#)

[报告期内基金投资策略和运作分析](#)

[报告期内基金的业绩表现](#)

[管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望](#)

[管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明](#)

[管理人对报告期内基金利润分配情况的说明](#)

[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](#)

[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](#)

[托管人报告](#)

[报告期内本基金托管人合规守信情况声明](#)

[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](#)

[托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见](#)

[半年度财务会计报告（未经审计）](#)

[资产负债表](#)

[利润表](#)

所有者权益（基金净值）变动表
报表附注
基金基本情况
会计报表的编制基础
遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
重要会计政策和会计估计
会计年度
记账本位币
金融资产和金融负债的分类
金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
金融资产和金融负债的估值原则
金融资产和金融负债的抵销
实收基金
损益平准金
收入/(损失)的确认和计量
费用的确认和计量
基金的收益分配政策
分部报告
其他重要的会计政策和会计估计
会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
会计政策变更的说明
会计估计变更的说明
差错更正的说明
税项
重要财务报表项目的说明
银行存款
交易性金融资产
衍生金融资产/负债
买入返售金融资产
各项买入返售金融资产期末余额
期末买断式逆回购交易中取得的债券
应收利息
其他资产
应付交易费用
其他负债
实收基金
未分配利润
存款利息收入
股票投资收益
股票投资收益——买卖股票差价收入
债券投资收益
债券投资收益项目构成
债券投资收益——买卖债券差价收入
债券投资收益——赎回差价收入

债券投资收益——申购差价收入
资产支持证券投资收益
衍生工具收益
衍生工具收益——买卖权证差价收入
衍生工具收益——其他投资收益
股利收益
公允价值变动收益
其他收入
交易费用
其他费用
分部报告
或有事项、资产负债表日后事项的说明
或有事项
资产负债表日后事项
关联方关系
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
本报告期与基金发生关联交易的各关联方
本报告期及上年度可比期间的关联方交易
通过关联方交易单元进行的交易
股票交易
权证交易
应支付关联方的佣金
关联方报酬
基金管理费
基金托管费
销售服务费
与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
各关联方投资本基金的情况
报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况
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
由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
其他关联交易事项的说明
利润分配情况
利润分配情况——货币市场基金
期末本基金持有的流通受限证券
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
期末持有的暂时停牌等流通受限股票
期末债券正回购交易中作为抵押的债券
银行间市场债券正回购
交易所市场债券正回购
金融工具风险及管理
风险管理政策和组织架构
信用风险

按短期信用评级列示的债券投资
按长期信用评级列示的债券投资
流动性风险
金融资产和金融负债的到期期限分析
市场风险
利率风险
利率风险敞口
利率风险的敏感性分析
外汇风险
外汇风险敞口
外汇风险的敏感性分析
其他价格风险
其他价格风险敞口
其他价格风险的敏感性分析
采用风险价值法管理风险
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
投资组合报告
期末基金资产组合情况
债券回购融资情况
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明
基金投资组合平均剩余期限
投资组合平均剩余期限基本情况
报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明
期末投资组合平均剩余期限分布比例
期末按债券品种分类的债券投资组合
期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细
“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明
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
投资组合报告附注
基金计价方法说明
本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 天的浮动利率债券说明
受到调查以及处罚情况
期末其他各项资产构成
投资组合报告附注的其他文字描述部分
基金份额持有人信息
期末基金份额持有人户数及持有人结构
期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
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
发起式基金发起资金持有份额情况
开放式基金份额变动
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议

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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
偏离度绝对值超过 0.5%的情况
其他重大事件
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议
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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
偏离度绝对值超过 0.5%的情况
其他重大事件
影响投资者决策的其他重要信息
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
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录
备查文件目录
存放地点
查阅方式

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。

基金基本情况

项目

数值

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

场内简称

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

2015-01-14

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

基金合同存续期

不定期

下属 2 级基金的基金简称

国开货币 A

国开货币 B

下属 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

000901

000902

报告期末下属 2 级基金的份额总额

193,593,635.40

69,458,083.55

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。

下属分级基金的风险收益特征

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

郑文杰

周慕冰

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

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
主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期

报告期(2017-01-01 至 2017-06-30)

国开货币

国开货币 A

国开货币 B

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

加权平均基金份额本期利润

本期加权平均净值利润率

-%

-%

-%

本期基金份额净值增长率

-%

-%

-%

本期净值收益率

-%

1.8948 %

2.0161 %

报告期末

报告期末(2017-06-30)

国开货币

国开货币 A

国开货币 B

期末可供分配利润

期末可供分配基金份额利润

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

报告期末

报告期末(2017-06-30)

国开货币

国开货币 A

国开货币 B

基金份额累计净值增长率

-%

-%

-%

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。

基金净值表现

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 A

阶段

净值收益率①

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 %

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 B

阶段

净值收益率①

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：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。

自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 A

自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 B

注：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。

基金管理人及基金经理情况

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。

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

2015-01-14

-

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

2017-03-27

-

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。

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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

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%。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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。

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%。

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。

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。

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。

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

-

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。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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。

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。

托管人对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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

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：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

资产：

银行存款

101,262.60

33,516,406.70

结算备付金

-

-

存出保证金

-

-

交易性金融资产

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

-

-

买入返售金融资产

44,850,307.28

223,401,215.10

应收证券清算款

-

-

应收利息

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

-

-

资产总计

307,294,494.11

689,789,587.28

负债和所有者权益

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

负债：

短期借款

-

-

交易性金融负债

-

-

衍生金融负债

-

-

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
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
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
263,051,718.95
668,046,044.89
未分配利润
-
-
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。

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：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

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

-

-

 基金投资收益

-

-	
	债券投资收益
250,646.81	
818,681.53	
	资产支持证券投资收益
-	
-	
	贵金属投资收益
-	
-	
	衍生工具收益
-	
-	
	股利收益
-	
-	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	
-	
-	
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	
-	
-	
5.其他收入（损失以“-”号填列）	
-	
-	
减：二、费用	
2,550,173.45	
1,986,653.61	
1. 管理人报酬	
898,959.69	
818,920.81	
2. 托管费	
272,412.04	
248,157.83	
3. 销售服务费	
285,250.91	
164,637.83	
4. 交易费用	
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

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

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 1 月 14 日。

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：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

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）

410,833,473.82

-

668,046,044.89

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

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

2016-01-01 至 2016-06-30

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（本期净利润）

-

7,564,987.98

7,564,987.98

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

-

668,046,044.89

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 1 月 14 日。

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李鑫 主管会计工作负责人：朱瑜 会计机构负责人：姚劼

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

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)。

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。

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。

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。

会计年度

本期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。

记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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。

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。

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。

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。

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。

损益平准金

-

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。

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。

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。

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。

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。

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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。

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。

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。

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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

活期存款

101,262.60

-

定期存款

-

-

其中：存款期限 1-3 个月

-

-

其他存款

-

-

合计

101,262.60

33,516,406.70

注：注：定期存款的存款期限指票面存期。

交易性金融资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

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

259,425,058.79

259,877,000.00

451,941.21

0.1718

合计

259,425,058.79

259,877,000.00

451,941.21

0.1718

项目

上年度末

2016-12-31

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

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：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。

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

项目

上年度末

2016-12-31

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

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
2017-06-30
账面余额
其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间
44,850,307.28
-
合计
44,850,307.28
-

项目
上年度末
2016-12-31
账面余额
其中：买断式逆回购
注：本基金本报告期末各项买入返售金融资产无期末余额。
期末买断式逆回购交易中取得的债券
单位：人民币元

项目
本期末
2017-06-30
债券代码
债券名称
约定返售日
估值单价
数量（张）
估值总额
其中：已出售或再质押总额

项目
上年度末
2016-12-31
债券代码
债券名称
约定返售日
估值单价
数量（张）
估值总额
其中：已出售或再质押总额

注：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。

应收利息
单位：人民币元

项目
本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应收活期存款利息

18.37

-

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

-

-

应收债券利息

2,384,334.24

-

应收买入返售证券利息

75,748.61

-

应收申购款利息

-

-

应收黄金合约拆借孳息

-

-

其他

-

-

合计

2,460,101.22

5,987,264.61

其他资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

其他应收款

-

-

待摊费用

-

-

合计

-

-

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

应付交易费用

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

交易所市场应付交易费用

-

-

银行间市场应付交易费用

21,363.19

-

合计

21,363.19

30,647.74

其他负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应付券商交易单元保证金

-

-

应付赎回费

-

-

预提费用

182,560.90

-

合计

182,560.90

359,000.00

实收基金

单位：人民币元

项目

本期	
2017-01-01 至 2017-06-30	
国开货币 A	
国开货币 B	
基金份额 (份)	
账面金额	
基金份额 (份)	
账面金额	
上年度末	
	188,884,267.13
	188,884,267.13
	479,161,777.76
	479,161,777.76
本期申购	
	548,210,737.84
	548,210,737.84
	436,949,006.36
	436,949,006.36
本期赎回 (以“-”号填列)	
	-543,501,369.57
	-543,501,369.57
	-846,652,700.57
	-846,652,700.57
本期末	
	193,593,635.40
	193,593,635.40
	69,458,083.55
	69,458,083.55
未分配利润	
国开货币 A	
单位: 人民币元	
项目	
已实现部分	
未实现部分	
未分配利润合计	
上年度末	
	-
	-
	-
本期利润	
	3,996,896.22
	-
	3,996,896.22
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

-3,996,896.22

-

-3,996,896.22

本期末

-

-

-

国开货币 B

单位：人民币元

项目

已实现部分

未实现部分

未分配利润合计

上年度末

-

-

-

本期利润

6,365,651.29

-

6,365,651.29

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

-6,365,651.29

-

-6,365,651.29

本期末

-

-

-

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

活期存款利息收入

1,430.21

-

定期存款利息收入

466,666.65

-

其他存款利息收入

-

-

结算备付金利息收入

-

-

其他

-

-

合计

468,096.86

2,710.26

注：注：本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出股票成交总额

-
-
减：卖出股票成本总额
-
-
买卖股票差价收入
-
-
债券投资收益
债券投资收益项目构成
单位：人民币元
项目
本期
2017-01-01 至 2017-06-30
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入
250,646.81
-
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
250,646.81
818,681.53
债券投资收益——买卖债券差价收入
单位：人民币元
项目
本期
2017-01-01 至 2017-06-30
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额
1,206,194,620.19
-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额
1,198,796,497.77
-
减：应收利息总额
7,147,475.61
-

买卖债券差价收入

250,646.81

-

债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

赎回基金份额对价总额

-

-

减：现金支付赎回款总额

-

-

减：赎回债券成本总额

-

-

减：赎回债券应收利息总额

-

-

赎回差价收入

-

-

注：本基金本报告期内无债券投资赎回差价收入。

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

申购基金份额对价总额

-

-

减：现金支付申购款总额

-

-

减：申购债券成本总额

-

-

减：申购债券应收利息总额

-

-
申购差价收入

-
-

注：本基金本报告期内无债券投资申购差价收入。

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-
-

减：卖出资产支持证券成本总额

-
-

减：应收利息总额

-
-

资产支持证券投资收益

-
-

注：本基金本报告期内未投资资产支持证券。

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出权证成交总额

-
-

减：卖出权证成本总额

-
-

买卖权证差价收入

-
-

注：本基金本报告期内无买卖收益权证差价收入。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间收益金额

2016-01-01 至 2016-06-30

国债期货投资收益

-

-

股指期货-投资收益

-

-

注：本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

股利收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

股票投资产生的股利收益

-

-

基金投资产生的股利收益

-

-

合计

-

-

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

1.交易性金融资产

-

-

——股票投资

-

-

——债券投资

-

-

——资产支持证券投资

-

-

——基金投资

-

-

——贵金属投资

-

-

——其他

-

-

2.衍生工具

-

-

——权证投资

-

-

3.其他

-

-

合计

-

-

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

基金赎回费收入

-

-

合计

-

-

注：本基金本报告期内无其他收入。

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30
交易所市场交易费用

-

-

银行间市场交易费用
100.00

-

合计
100.00

-

注：本基金本报告期内无交易费用。

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

审计费用

29,752.78

-

信息披露费

143,808.12

-

其他费用

780.00

-

银行汇划费用

28,463.79

-

银行间账户维护费

18,000.00

-

合计

220,804.69

218,159.12

分部报告

无。

或有事项、资产负债表日后事项的说明

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。

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。

关联方关系

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

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。

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。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：本基金本报告期末未通过关联方交易单元进行股票交易。

权证交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：本基金本报告期末未通过关联方交易单元进行权证交易。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方名称

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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：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。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

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

2016-01-01 至 2016-06-30

当期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：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。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购

基金正回购

基金买入

基金卖出

交易金额

利息收入

交易金额

利息支出

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

银行间市场交易的各关联方名称

债券交易金额

基金逆回购
基金正回购
基金买入
基金卖出
交易金额
利息收入
交易金额
利息支出

注：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。

各关联方投资本基金的情况

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

份额级别

国开货币 A

国开货币 B

国开货币 A

国开货币 B

基金合同生效日（2015-01-14）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

-

30,476,007.40

期间因拆分增加的份额

-

-

-

-

减：期间赎回/卖出总份额

-

64,000,000.00

-

30,775,270.96

期末持有的基金份额

-

33,262,559.00

-

90,670,387.44

期末持有的基金份额占基金总份额比例

-%

12.64 %

-%

7.30 %

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 10,00,000.00 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 10,00,000.00 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 20,00,000.00 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。

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

项目

国开货币 A

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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

项目

国开货币 B

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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

29.95 %

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 100,00,000.00 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。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

期末余额

当期利息收入

期末余额

当期利息收入

注：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。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

关联方名称

证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

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。

利润分配情况

利润分配情况——货币市场基金国开货币 A

单位：人民币元

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

3,929,751.68

-

67,144.54

3,996,896.22

-

利润分配情况——货币市场基金国开货币 B

单位：人民币元

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

6,399,220.75

-

-33,569.46

6,365,651.29

-

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

受限证券类别：债券

证券代码

证券名称
成功认购日
可流通日
流通受限类型
认购价格
期末估值单价
数量（单位：股）
期末成本总额
期末估值总额
备注

注：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。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码
股票名称
停牌日期
停牌原因
期末估值单价
复牌日期
复牌开盘单价
数量（股）
期末成本总额
期末估值总额
备注

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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

2017-07-03

99.07

200,000

19,814,492.64

160419

16 农发 19

2017-07-03

99.95

100,000

9,995,120.83

111711234

17 平安银行 CD234

2017-07-03

99.01

145,000

14,356,618.39

合计

445,000

44,166,231.86

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。

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。

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之内。

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。

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

A-1

20,069,185.75

112,926,044.23

A-1 以下

0.00

0.00

未评级

121,808,989.60

191,742,249.90

合计

141,878,175.35

304,668,294.13

注：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。

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

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

AAA

-

-

AAA 以下

-

-

未评级

-

-

合计

-

-

注：于 2017 年 6 月 30 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(2016 年 12 月 31 日：本基金未持有按长期信用评级的债券投资)。

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%。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末
2017-06-30

合计
资产
资产总计
-
负债
负债总计
-
流动性净额
-

上年度末
2016-12-31

合计
资产
资产总计
-
负债
负债总计
-
流动性净额
-

注：无。

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。

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。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末
2017-06-30

6个月以内
6个月-1年
不计息
合计
资产
银行存款
101,262.60

-
-
101,262.60
交易性金融资产
259,425,058.79
-
-
259,425,058.79
买入返售金融资产
44,850,000.00
-
-
44,850,000.00
应收利息
-
-
2,460,101.22
2,460,101.22
应收申购款
-
-
457,764.22
457,764.22
其他资产
-
-
307.28
307.28
资产总计
304,376,321.39
-
2,918,172.72
307,294,494.11
负债
卖出回购金融资产款
43,709,658.14
-
-
43,709,658.14
应付管理人报酬
-
-
112,001.57
112,001.57

应付托管费
-
-
33,939.86
33,939.86
应付销售服务费
-
-
49,587.25
49,587.25
应付交易费用
-
-
21,363.19
21,363.19
应付利息
-
-
9,558.61
9,558.61
应付利润
-
-
124,105.64
124,105.64
其他负债
-
-
182,560.90
182,560.90
负债总计
43,709,658.14
-
533,117.02
44,242,775.16
利率敏感度缺口
260,666,663.25
-
2,385,055.70
263,051,718.95
上年度末
2016-12-31
6个月以内
6个月-1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
223,400,000.00
-
-
223,400,000.00
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
其他资产
-
-
1,215.10
1,215.10
资产总计
595,947,672.68
79,565,217.98
14,276,696.62
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

574,952,904.17

79,565,217.98

13,527,922.74

668,046,044.89

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。

利率风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

注：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。

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。

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

项目

上期末

2016-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-

-

资产负债表外汇风险敞口净额

-

-

-

-

外汇风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

公允价值

占基金资产净值比例 (%)

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

-

-

-

-

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

259,877,000.00

98.79

418,829,000.00

62.69

其他价格风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

注：无。

采用风险价值法管理风险

无。

假设

-

-

分析

风险价值（金额单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

注：无。

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 and 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。

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。

债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号

项目

占基金总资产的比例（%）

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

占基金总资产的比例（%）

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：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%。

基金投资组合平均剩余期限

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：注：报告期内投资组合平均剩余限未超过 120 天。

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

7.6

-

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

报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：注：报告期内投资组合平均剩余限未超过 240 天。

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

-

-

期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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：注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

“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 %

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

0.0836 %

注：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

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

注：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

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

注：本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

基金计价方法说明

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。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

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

投资组合报告附注的其他文字描述部分