

国开泰富货币市场证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 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：2018 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示

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 2018 年 3 月 26 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 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	439,654,667.02 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	186,858,927.62 份	252,795,739.40 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	贺倩
	联系电话	010-59363088	010-66060069
	电子邮箱	xiaoqiang@cdfsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-59363299	95599
传真		010-59363220	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cdbsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和指 标	2017 年		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	国开货币 A	国开货币 B
本期 已实 现收 益	8,618,879.23	9,331,599.69	4,430,860.45	10,416,537.65	12,116,798.99	5,905,199.60
本期 利润	8,618,879.23	9,331,599.69	4,430,860.45	10,416,537.65	12,116,798.99	5,905,199.60
本期 净值 收益 率	3.8879%	4.1376%	2.9925%	3.2396%	3.4670%	3.7087%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	国开货币 A	国开货币 B	国开货币 A	国开货币 B	国开货币 A	国开货币 B
期末 基金 资产 净值	186,858,927.62	252,795,739.40	188,884,267.13	479,161,777.76	94,629,315.89	191,859,141.61
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1. 本基金无持有人认购或交易基金的各项费用；

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

除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国开货币 A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.9826%	0.0062%	0.3403%	0.0000%	0.6423%	0.0062%
过去六个月	1.9561%	0.0061%	0.6805%	0.0000%	1.2756%	0.0061%
过去一年	3.8879%	0.0066%	1.3500%	0.0000%	2.5379%	0.0066%
自基金合同生效起至今	10.7064%	0.0113%	4.0056%	0.0000%	6.7008%	0.0113%

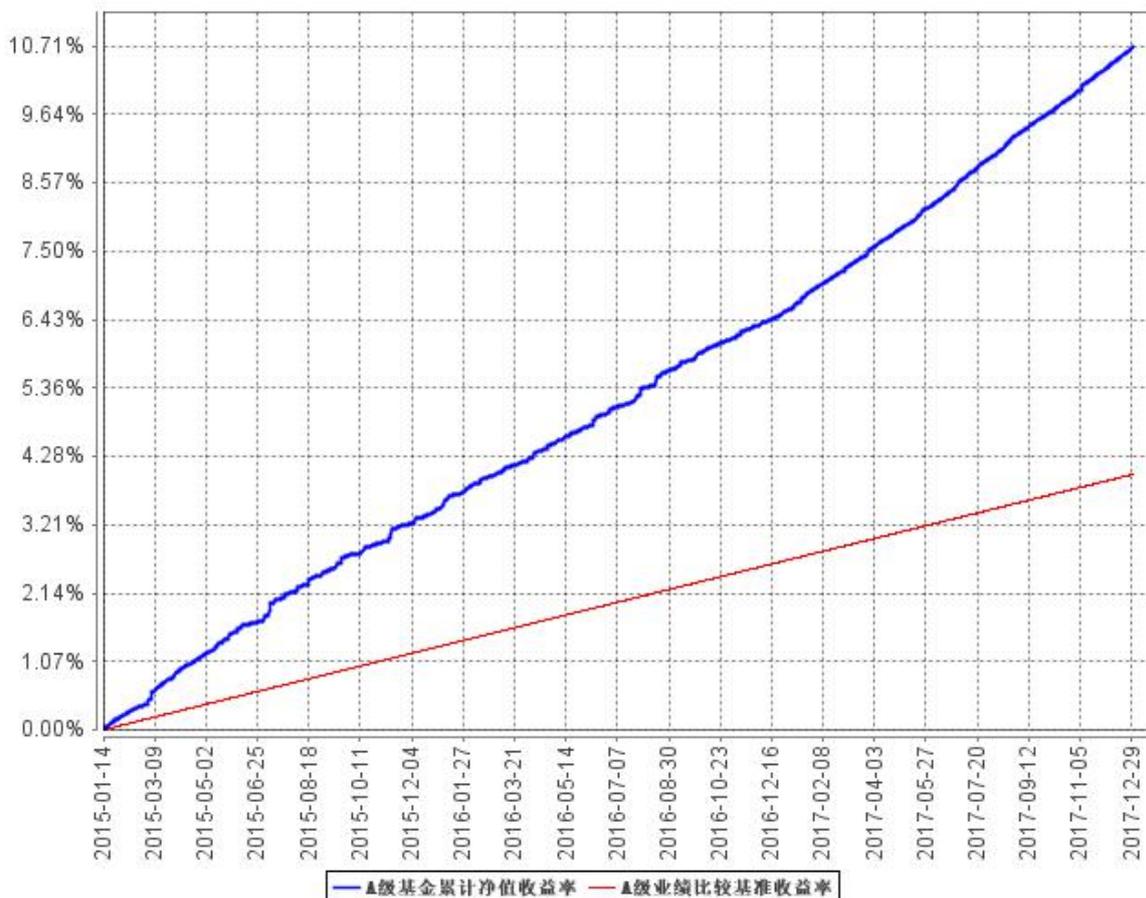
国开货币 B

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	1.0439%	0.0062%	0.3403%	0.0000%	0.7036%	0.0062%
过去六个月	2.0796%	0.0061%	0.6805%	0.0000%	1.3991%	0.0061%
过去一年	4.1376%	0.0066%	1.3500%	0.0000%	2.7876%	0.0066%
自基金合同生效起至今	11.4985%	0.0113%	4.0056%	0.0000%	7.4929%	0.0113%

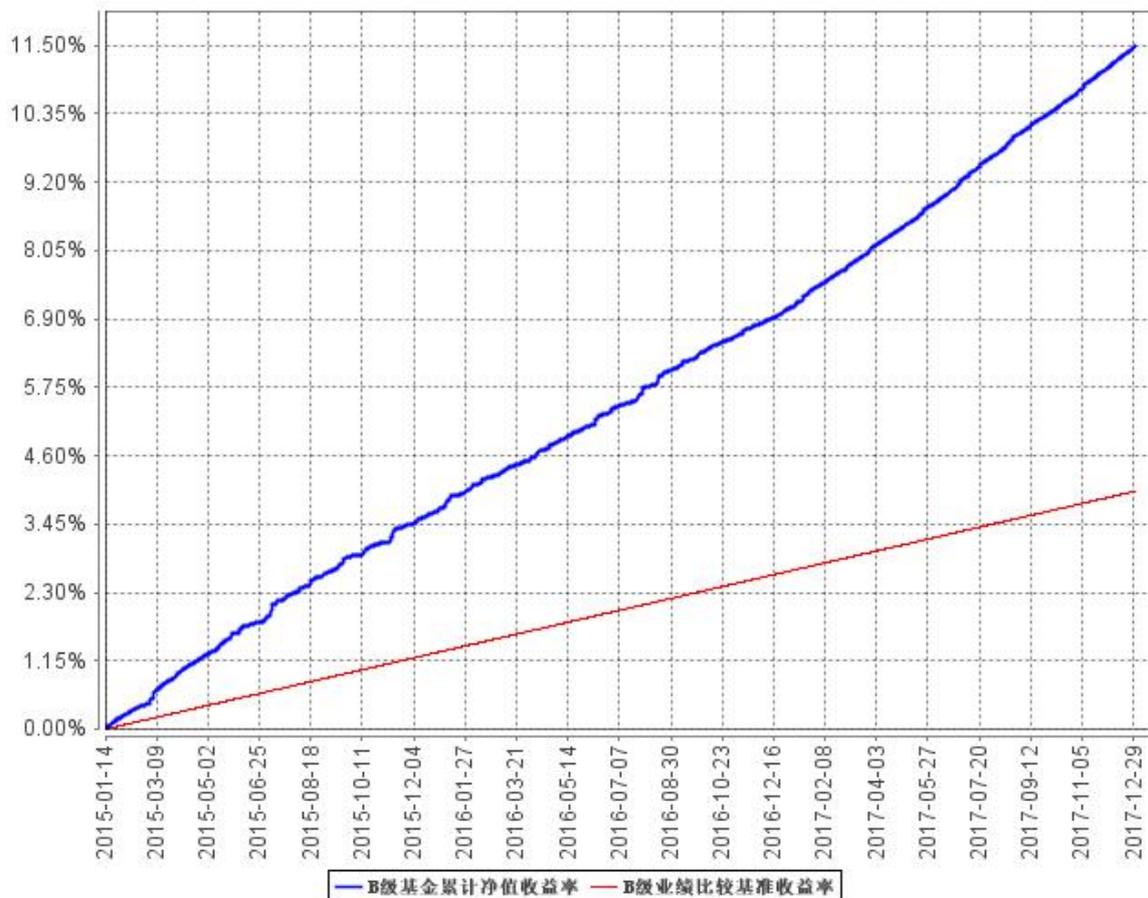
注：本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）。

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

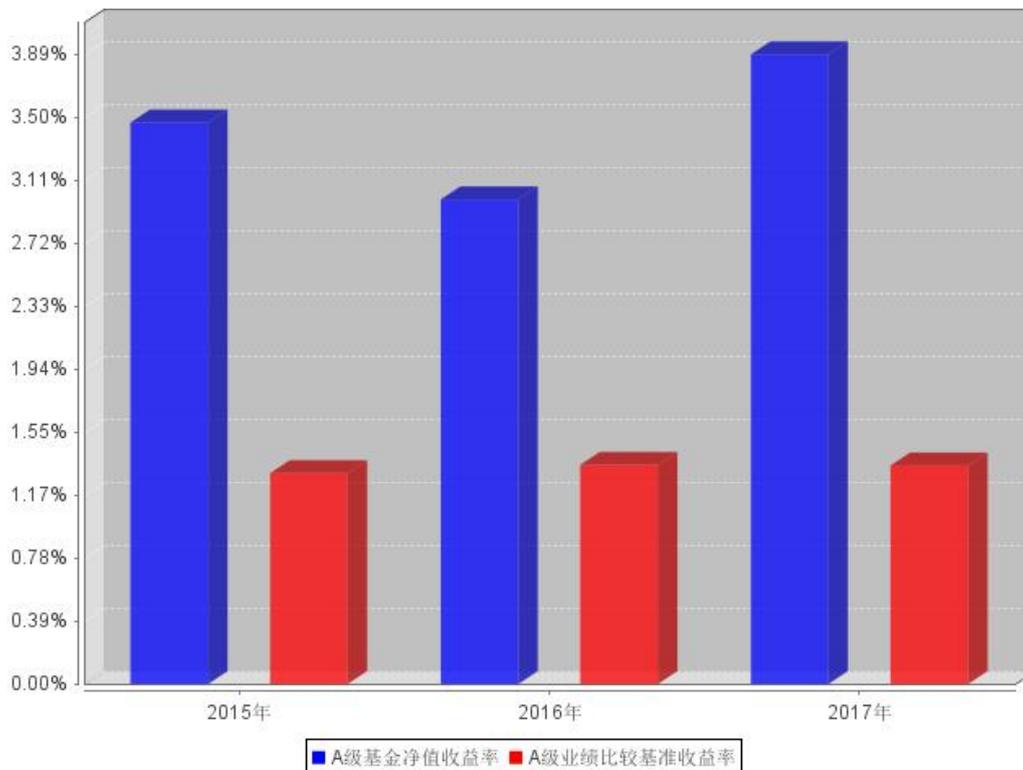


注：1、本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）；

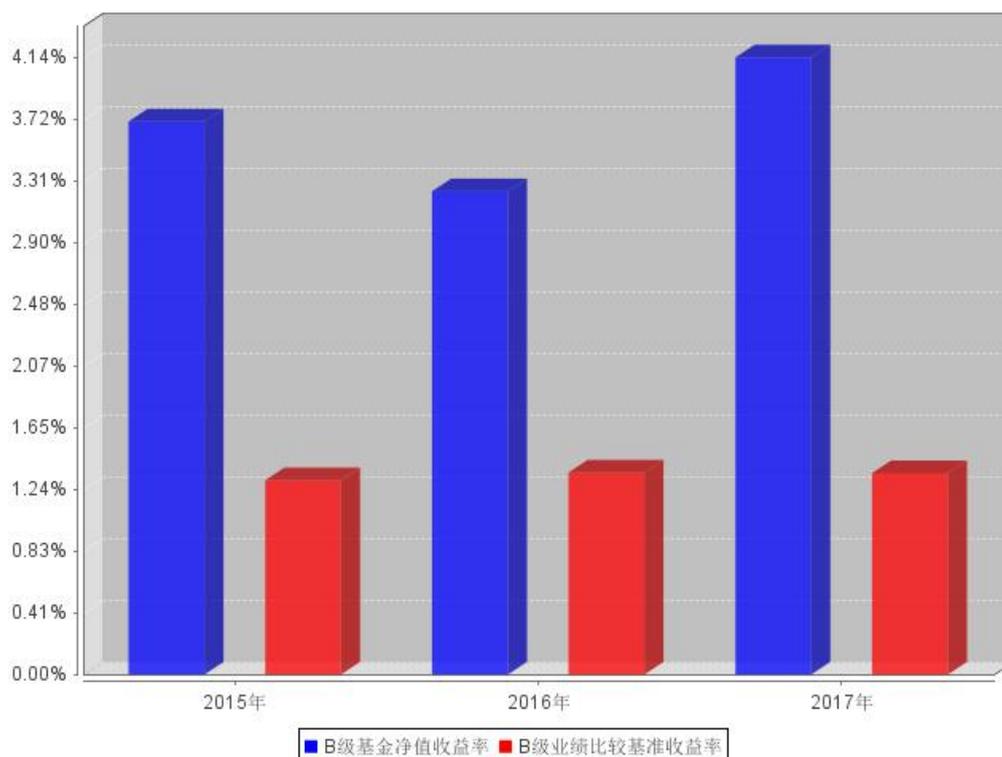
2、本基金基金合同于 2015 年 1 月 14 日生效，至本报告期末未满 1 年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

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 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
2017	8,577,820.49	-	41,058.74	8,618,879.23	-
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	25,101,627.03	-	64,911.64	25,166,538.67	-
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
2017	9,305,486.02	-	26,113.67	9,331,599.69	-
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	25,560,545.61	-	92,791.33	25,653,336.94	-

§ 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，注册资本为人民币叁亿陆仟万元整，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 12 月 31 日，公司旗下管理 4 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、国开泰富开航灵活配置混合型发起式证券投资基金。同时，公司还管理多个特定客户资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
洪宴	投资总监， 本基金基金经理	2015 年 1 月 14 日	-	4 年 5 个月	北京大学光华管理学院商务统计与经济计量专业硕士，曾任中国光大银行资金部投资交易处处长，货币与债券交易处副处长（主持工作），货币与债券交易处业务副经理/经理；特许金融分析师（CFA）、加拿大证券业协会（CSI）衍生品交易资格（DFC）认证，曾获 2010 年及 2012 年全国银行间本币市场优秀交易主管。
王婷婷	本基金基金经理	2017 年 3 月 27 日	-	7 年 5 个月	中央财经大学经济法专业硕士，曾任益民基金管理有限公司益民货币市场基金、益民多利债券混合型证券投资基金基金经理，交易部副总经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.3 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

2017 年债券市场终结 2013 年以来的一波大牛市，一季度，债券市场在经历了 2016 年年末收益率急速调整后，伴随着央行对跨年资金的呵护以及政策空档期，市场小幅回暖，十年期国债收益率调整至 3.3% 附近；平稳跨过季末后，二季度开始，4 月下旬，一行三会密集出台相关文件，旨在针对“三违反、三套利、四不当”，对同业存单、资金空转、多层嵌套将进行规范同时陆续出台相关监管政策，十年期国债迅速上行至 3.7%，十年期国开上行至 4.5%，同时 6 月份同业存单收益率再次引起关注，3 个月 shior 上行至上半年度高点 4.71%，3M 国股银行存单收益率发行至 5%，整个 6 月份资金呈现出有量价高的局面；三季度，宏观经济数据亮眼，7 月份公布 GDP6.9%，

7月中下旬，中央政治局会议召开，“稳”字诉求强烈，强调地方债风险以及房地产调控，市场情绪有所缓和，但8月经济数据再次证明经济韧性较强，同时大宗商品开启下半年的一轮大涨行情，黑色系受供给侧改革及环保限产影响价格上涨，债市对利好和利空钝化，十年期国债在3.6%附近震荡，十年期国开在4.25%附近震荡；四季度监管政策陆续落地，债券市场迎来年内幅度最大的一次调整。十月份金融数据超预期，实体经济融资需求强劲，下旬，受小川行长四季度GDP可能破7%等不利因素影响，脆弱的债券市场情绪崩溃，十年期国债收益率上行至3.8%，十年期国开上行至4.4%，11月，债券市场悲观情绪依然严重，月中资管新规征求意见稿出台，收益率加速上行，十年期国债最高上行至4%，十年期国开最高上行至5%，12月初，监管政策继续落地，商业银行流动性征求意见稿出台，更加严格的监管引发了市场对于明年流动性的担忧，但由于过渡期较长，并没有引起市场巨幅波澜，中旬，美国税改通过，加息落地，利空出尽行情再次显现，债券市场开启震荡模式，下旬开始，跨年资金价格飙升，再次呈现出6月末有量价高的局面，同时伴随着月内资金泛滥，12月同业存单发行压力较大，各期限价格突破6月高点，同时带动二级存单收益率上行，3M国股收益率至5.1%，资金面的担忧引发跨节资金和月内到期价格差距悬殊。

回顾2017年，债券市场巨幅调整归纳为以下几个原因：

一、金融去杠杆，央行货币政策削峰填谷、不松不紧，商业银行超储率全年处于低位，M2下降至个位数，导致资金面的不稳定，债券市场最大的配置力量银行端全年缺负债，国股AAA评级3M同业存单发行利率在年末突破5.1%，小银行更是不惜成本续命3M存单收益率发行指5.5%，同时银行赎回非银产品，引起资产的抛售加速了收益率的上行。

二、宏观经济方面，经济韧性超预期，通胀温和，具体来看，投资方面，棚改带动房地产投资全年不弱，虽然在地产政策调控后一二线城市销售数据下滑，但三四线城市由于棚改带动的购房需求仍强，基建发力，全年财政支出超预期；外需方面，在欧美经济复苏带动下，出口超预期，外汇储备增加；价格方面，供给侧改革以及环保限产带来大宗商品价格上涨，上游龙头工业企业利润大幅改善，但上下游传导不畅，CPI在2以下较为温和，全年的经济超预期以及PPI同比全年高位，推动债券收益率曲线的上移，也为金融去杠杆留出了时间和空间。

三、美联储税改以及加息。2017年美联储如期加息三次，基准利率上调至1.25%-1.5%，央行两次跟随上调公开市场操作利率，7D逆回购上调至2.5%、14D逆回购上调至2.65%、28D逆回购上调至2.8%、MLF上调至3.25%，公开市场操作利率的上调以及资金面的不稳定，引起短端债券利率的上移，对于人民币汇率起到稳定性的作用，同时收益率曲线的平坦化有助于金融去杠杆、减少套利以及空转。

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，三季度缩短组合久期，配置上仍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 9 月末的货币市场资金紧张时，提前准备出应对流动性压力的资金，整体组合稳健而富有弹性，投资业绩优异。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，国开货币 A 净值增长率 3.8879%，国开货币 B 净值增长率 4.1376%，业绩比较基准收益率为 1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一、商业银行流动性管理办法等监管政策将陆续落地，金融去杠杆防风险仍将继续，同时 2018 年定向降准开始执行，部分缓解银行负债端压力，受制于外围美联储加息缩表以及国内通胀温和上行压力，预计央行围绕“双支柱”框架，落实稳健中性的货币政策，以价格型调控为主，数量型调控为辅，若美联储 2018 年继续加息，不排除央行将继续跟随上调公开市场操作利率，甚至“不对称”上调存贷款基准利率的可能。尽管货币政策不松不紧，但由于各项监管细则的落地，市场关键时点上流动性摩擦成本大幅增加，倒逼各金融机构继续去杠杆。

二、宏观经济方面，预计宏观经济前高后低，全年 GDP 在 6.5%左右，具体来看，投资方面，棚改投资力度在 2018 年小幅下行，但仍对三四线城市地产投资起到一定的带动作用，房地产长效机制引导公租房、保障房建设，另外，2018 年地产债大量到期及回售将提升房企融资成本，因此预计 2018 年地产投资仍有支撑，但整体投资稳中趋缓。基建方面，受制于地方政府债开正门、堵偏门防风险、PPP 严格规范以及 2018 年的财政预算赤字，预计基建方面也将弱于 2017 年；进出口方面，欧美经济持续复苏，美国税改大力发展基建，外需仍有支撑；通胀方面，受低基数、油价、非食品类价格韧性的影响，预计 CPI 中枢将温和上行，PPI 跟随大宗商品黑色系价格逐渐下行。

三、债券市场，预计上半年收益率曲线仍将平坦。同业存单备案额度新规、流动性新规等等，均加剧金融机构对负债端的争夺，令短端利率维持高位；自低点已经大幅回升的长端利率，甚至已经超越信贷基准利率，在市场对于下半年经济下行预期较为一致的情况下，进一步走高的空间有限，但长端利率受制于资金面的不稳定以及短端利率高起，大幅下行空间有限，高位震荡的可能性较大。因此，上半年债券配置，我们倾向于保守偏防御策略，以短久期、高票息、高评级债券择时配置，同时少量仓位择机配置高评级、流动性好的中长久期债券，耐心等待各项监管政策的落地及市场脉冲式冲击，结合宏观经济数据等进一步研判后，再择机进行配置策略的调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.6.1.1 职责分工

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

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

4.6.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

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

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书等有关规定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。

4.8 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。

4.9 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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，未发现有关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（2018）第 20876 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
审计意见	<p>我们审计了国开泰富货币市场证券投资基金(以下简称“国开货币基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 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。</p> <p>我们认为,后附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,公允反映了国开货币基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国开货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国开货币基金的基金管理人国开泰富基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、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> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国开货币基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算国开货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国开货币基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的

<p>责任</p>	<p>重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国开货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致国开货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）</p>

注册会计师的姓名	单峰	程红粤
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2018 年 3 月 26 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		48,552.55	33,516,406.70
结算备付金		36,363.64	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		392,995,498.79	418,596,483.96
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		392,995,498.79	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		57,090,445.64	223,401,215.10
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,042,710.34	5,987,264.61
应收股利		-	-
应收申购款		776,810.00	8,288,216.91
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		452,990,380.96	689,789,587.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		12,572,741.14	20,994,768.51

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		121,720.16	167,285.62
应付托管费		36,884.88	50,692.58
应付销售服务费		47,781.52	47,027.40
应付交易费用		21,495.49	30,647.74
应交税费		-	-
应付利息		18,387.78	3,589.98
应付利润		157,702.97	90,530.56
递延所得税负债		-	-
其他负债		359,000.00	359,000.00
负债合计		13,335,713.94	21,743,542.39
所有者权益：			
实收基金		439,654,667.02	668,046,044.89
未分配利润		-	-
所有者权益合计		439,654,667.02	668,046,044.89
负债和所有者权益总计		452,990,380.96	689,789,587.28

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 439,654,667.02 份。其中国开货币 A 份额基金净值 1.00 元，基金份额总额 186,858,927.62 份；国开货币 B 份额基金净值 1.00 元，基金份额总额 252,795,739.40 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		22,511,436.33	19,158,911.74
1.利息收入		22,108,722.13	17,726,457.93
其中：存款利息收入		468,939.78	634,061.82
债券利息收入		18,287,447.08	13,291,916.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,352,335.27	3,800,479.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		402,714.20	1,432,453.81
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		402,714.20	1,432,453.81
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		4,560,957.41	4,311,513.64
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,538,324.70	1,658,477.34
2. 托管费	7.4.8.2.2	466,158.95	502,568.95
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	596,879.52	425,887.80
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		1,515,775.83	1,287,534.51
其中：卖出回购金融资产支出		1,515,775.83	1,287,534.51
6. 其他费用		443,818.41	437,045.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,950,478.92	14,847,398.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,950,478.92	14,847,398.10

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	668,046,044.89	-	668,046,044.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,950,478.92	17,950,478.92
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）	-228,391,377.87	-	-228,391,377.87
其中：1. 基金申购款	2,092,789,426.31	-	2,092,789,426.31
2. 基金赎回款	-2,321,180,804.18	-	-2,321,180,804.18

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）	-	-17,950,478.92	-17,950,478.92
五、期末所有者权益（基金净值）	439,654,667.02	-	439,654,667.02
项目	上年度可比期间 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

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

基金管理人负责人

朱瑜

主管会计工作负责人

姚劼

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）。

本财务报表由本基金的基金管理人国开泰富基金管理有限责任公司于 2018 年 3 月 26 日批准报出。

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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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。

7.4.5 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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国开泰富基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,538,324.70	1,658,477.34
其中：支付销售机构的客户维护费	542,329.50	452,030.25

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	466,158.95	502,568.95

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。

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

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年1月1日至2017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	9,986.84	15,528.50	25,515.34
中国农业银行股份有限公司	225,060.04	4,974.86	230,034.90
国开证券有限责任公司	419.49	13.70	433.19
合计	235,466.37	20,517.06	255,983.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额、B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%。计算方法如下：

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

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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	-	90,670,387.44
期间申购/买入总份额	-	7,319,871.91
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	64,000,000.00
期末持有的基金份额	-	33,990,259.35
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	7.73%

项目	上年度可比期间
----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 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	-	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	-	18.92%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额；

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

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

国开货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
北京国开泰富资产管理有限公司	3,052,503.13	0.6943%	-	-

国开货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国开证券有限责任公司	-	-	200,071,762.94	29.9488%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	48,552.55	2,227.27	3,516,406.70	4,089.58

股份有限公司				
--------	--	--	--	--

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

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作其他关联交易事项的说明。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 12,572,741.14 元，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
011755045	17 兖州煤业 SCP007	2018 年 1 月 4 日	100.02	68,000	6,801,272.42
011755045	17 兖州煤业 SCP007	2018 年 1 月 5 日	100.02	59,000	5,901,104.01
合计	-	-	-	127,000	12,702,376.43

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 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 392,995,498.79 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 2017 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(2016 年 12 月 31 日：同)。

(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 10 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 2017 年 12 月 31 日止的财

务状况和经营成果无影响。

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

§ 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	392,995,498.79	86.76
	其中：债券	392,995,498.79	86.76
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	57,090,445.64	12.60
	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	84,916.19	0.02
4	其他各项资产	2,819,520.34	0.62
5	合计	452,990,380.96	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	9.71	
	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	12,572,741.14	2.86
	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

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	56
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	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限未超过 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	35.69	2.86
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	20.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	27.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	12.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	6.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		102.39	2.86

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期限未超过 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	49,911,469.50	11.35
	其中：政策性金融债	49,911,469.50	11.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	55,001,902.88	12.51
6	中期票据	-	-
7	同业存单	288,082,126.41	65.52
8	其他	-	-
9	合计	392,995,498.79	89.39
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	170408	17 农发 08	500,000	49,911,469.50	11.35
2	011755045	17 兖州煤业 SCP007	200,000	20,003,742.40	4.55
3	011759076	17 蓝星 SCP002	200,000	19,993,720.98	4.55
4	111786605	17 徽商银行 CD158	200,000	19,952,927.75	4.54
5	111787040	17 南京银行 CD161	200,000	19,940,123.61	4.54
6	111708251	17 中信银行 CD251	200,000	19,914,294.40	4.53
7	111789440	17 宁波银行 CD225	200,000	19,860,605.26	4.52
8	111709483	17 浦发银行 CD483	200,000	19,826,481.22	4.51
9	111721238	17 渤海银行 CD238	200,000	19,822,042.71	4.51
10	111720281	17 广发银行 CD281	200,000	19,822,023.98	4.51

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1971%
报告期内偏离度的最低值	-0.0585%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0777%

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

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

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前十名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	2,042,710.34
4	应收申购款	776,810.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,819,520.34

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	6,609	28,273.40	7,889,623.47	4.22%	178,969,304.15	95.78%
国开货币 B	9	28,088,415.49	199,554,499.58	78.94%	53,241,239.82	21.06%
合计	6,618	66,433.16	207,444,123.05	47.19%	232,210,543.97	52.81%

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	机构	150,005,750.42	34.12%
2	机构	33,990,259.35	7.73%
3	个人	26,804,901.96	6.10%
4	机构	10,000,000.00	2.27%
5	个人	9,555,407.20	2.17%
6	个人	6,381,355.66	1.45%
7	个人	5,343,210.58	1.21%
8	机构	5,145,300.53	1.17%
9	个人	5,046,125.31	1.15%
10	机构	3,052,503.13	0.69%

9.3 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	267,488.70	0.1432%
	国开货币 B	-	-

	合计	267,488.70	0.0608%
--	----	------------	---------

9.4 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	0
	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	0
	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	188,884,267.13	479,161,777.76
本报告期基金总申购份额	1,178,937,511.20	913,851,915.11
减:本报告期基金总赎回份额	1,180,962,850.71	1,140,217,953.47
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	186,858,927.62	252,795,739.40

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

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会决议。

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 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，郑文杰自 2017 年 1 月 6 日起履行董事长职责）。

2017 年 7 月 14 日通过股东会 2017 年第三次会议决议，张志坚离任公司董事。

2017 年 7 月 14 日通过股东会 2017 年第三次会议决议，孟天山担任公司董事。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度，为本基金进行审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

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

本基金本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	-	-	80.00	100.00%	-

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	-	-	8,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期偏离度绝对值未超过 0.5%。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101 - 20170223	200,000,000.00	781,338.35	201,213,683.40	-	0.00%
	2	20170518 - 20170626	-	80,618,379.65	80,841,651.28	-	0.00%
	3	20171222 - 20171231	-	150,005,750.42	-	150,005,750.42	34.12%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金为货币基金，风险等级较低，单一投资者持有的份额比例过于集中达到或超过 20%，存在潜在流动性风险和集中赎回风险。但公司对该基金拥有完全自主投资决策权，报告期间严格按照法规和基金合同规定合规运作，严控流动性风险，单一投资者赎回本基金不会给本基金带来显著的流动性风险。因基金单位净值最末位小数致四舍五入的原因，单一投资者赎回本基金可能给存续投资者带来一定程度的净值损失。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

国开泰富基金管理有限责任公司
2018 年 3 月 27 日