

国开泰富开泰灵活配置混合型  
证券投资基金  
2018 年半年度报告摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：国开泰富基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 08 月 22 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	国开开泰混合	
基金主代码	003762	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 27 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	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	212,613,300.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国开开泰混合 A	国开开泰混合 C
下属分级基金的交易代码:	003762	003763
报告期末下属分级基金的份额总额	10,575,876.88 份	202,037,423.22 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过专业的研究分析，力求超越业绩比较基准的资产回报，为投资者实现资产长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，在评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率的基础上，动态优化调整权益类、固定收益类等大类资产的配置。在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。

	<p>2、股票投资策略</p> <p>在灵活的类别资产配置的基础上，本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，严选其中安全边际较高的个股构建投资组合：自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等；并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判，严选安全边际较高的个股。</p> <p>3、固定收益投资策略</p> <p>本基金将根据当前宏观经济形势、金融市场环境，运用基于债券研究的各种投资分析技术，进行个券精选。</p> <p>4、股指期货、权证等投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，构建交易组合。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*30%+中债总财富（总值）指数收益率*70%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。

### 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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	岳斌
	联系电话	010-59363088
	电子邮箱	yuebin@cdbsfund.com
客户服务电话	010-59363299	95558
传真	010-59363220	010-85230024

### 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	国开开泰混合 A	国开开泰混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	178,602.68	3,129,773.49

本期利润	236,227.29	4,267,370.97
加权平均基金份额本期利润	0.0234	0.0211
本期基金份额净值增长率	2.26%	2.05%
3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2018年6月30日)		
期末可供分配基金份额利润	0.0093	0.0028
期末基金资产净值	10,674,694.65	202,608,341.99
期末基金份额净值	1.0093	1.0028

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 2016 年 12 月 27 日。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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

国开开泰混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.24%	0.07%	-1.63%	0.37%	1.39%	-0.30%
过去三个月	0.42%	0.11%	-1.16%	0.35%	1.58%	-0.24%
过去六个月	2.26%	0.11%	-0.58%	0.34%	2.84%	-0.23%
过去一年	3.52%	0.09%	1.96%	0.28%	1.56%	-0.19%
自基金合同生效起至今	5.84%	0.08%	5.00%	0.26%	0.84%	-0.18%

国开开泰混合 C

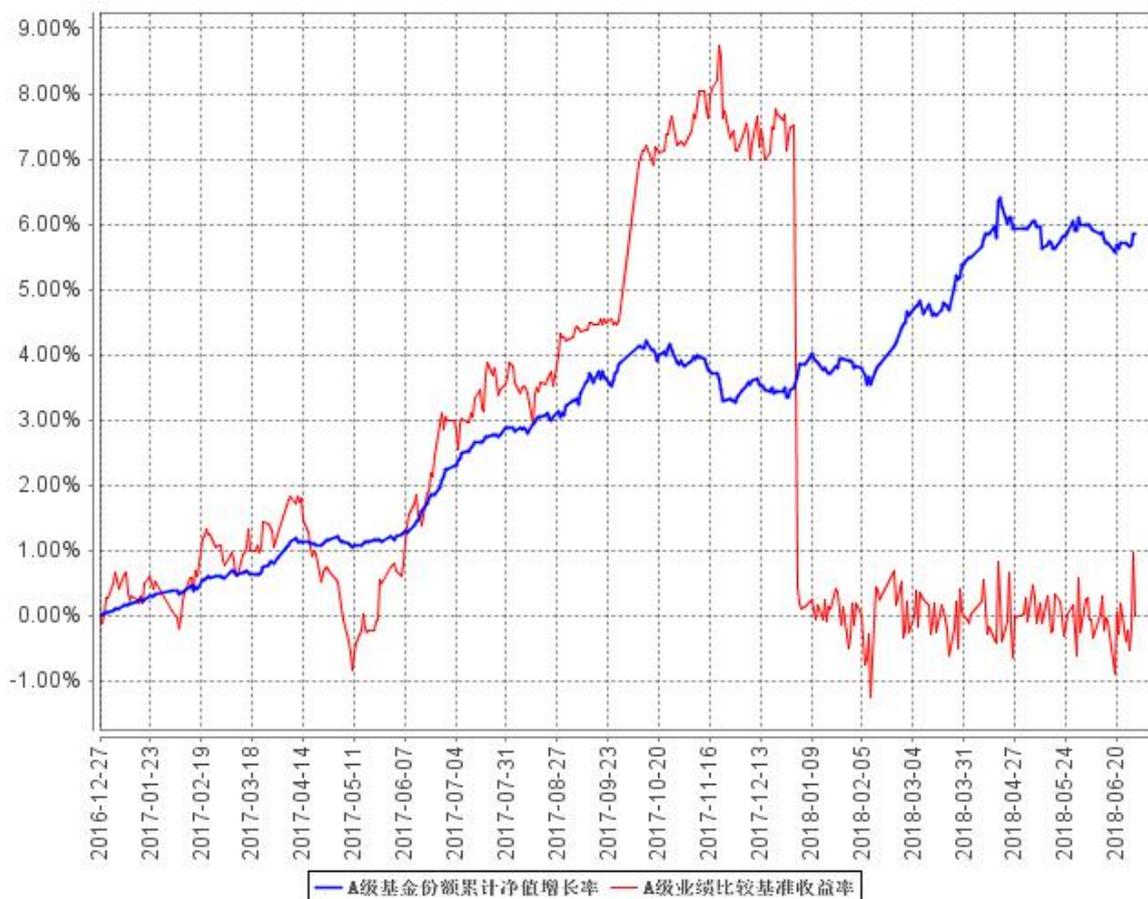
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.28%	0.07%	-1.63%	0.37%	1.35%	-0.30%
过去三个月	0.32%	0.11%	-1.16%	0.35%	1.48%	-0.24%
过去六个月	2.05%	0.11%	-0.58%	0.34%	2.63%	-0.23%
过去一年	3.09%	0.09%	1.96%	0.28%	1.13%	-0.19%
自基金合同生效起至今	5.19%	0.08%	5.00%	0.26%	0.19%	-0.18%

注：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 27 日生效。

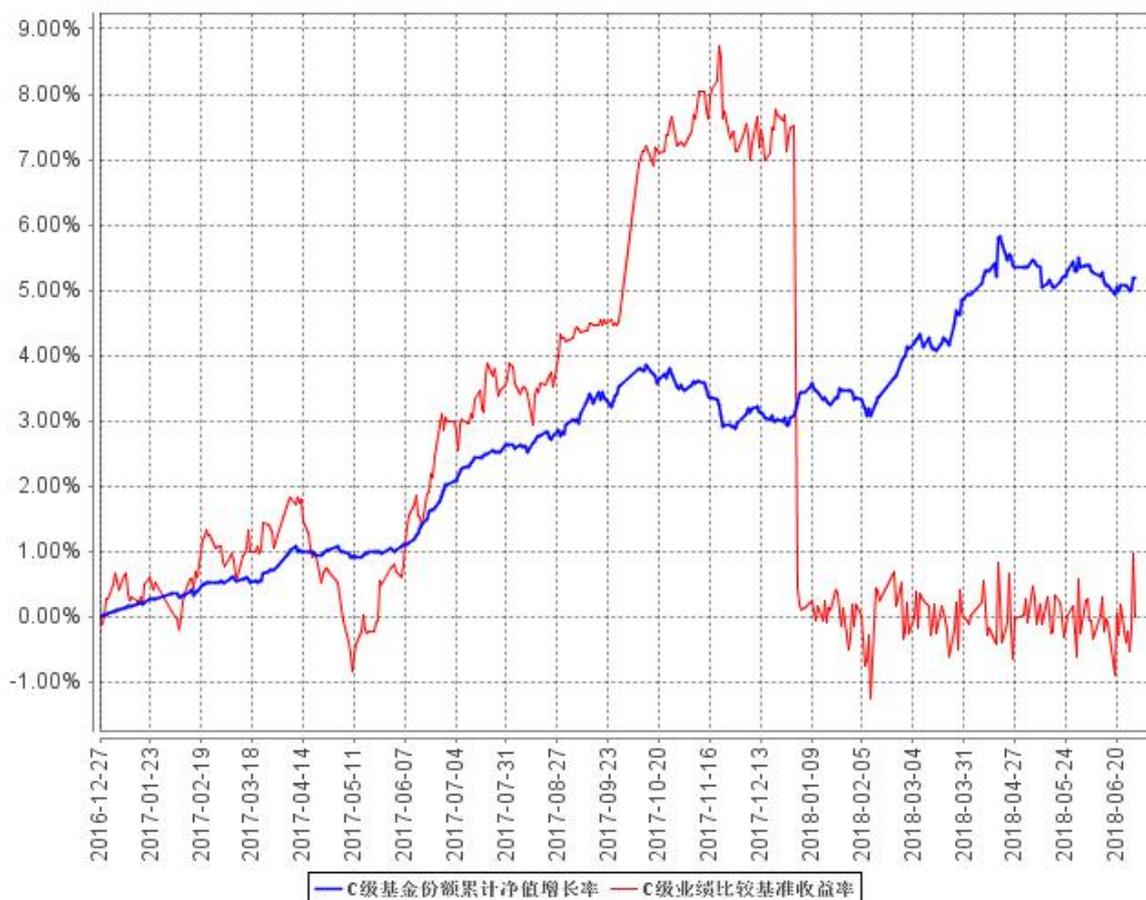
2、截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定。

### 3.2.2 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级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长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中债总财富(总值)\*70%+沪深 300 指数收益率\*30%；  
 2、本基金基金合同于 2016 年 12 月 27 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投资限制的有关约定。

## § 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，其中国开证券股份有限公司出资比例为 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 2018 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		
何玄文	权益投资总监, 本基金基金经理	2018年6月19日	-	12年	清华大学技术经济及管理硕士, 曾任北京乐正资本管理有限公司投资组量化投资总监, 曾就职于中信证券, 先后担任研究部研究员、资产管理部研究员、研究主管、投资经理、投资主管。
洪宴	固定收益投资总监, 本基金基金经理	2016年12月27日	2018年6月5日	4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	2018年5月30日	-	7年11个月	中央财经大学经济学法专业硕士, 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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人, 保护各类投资人利益, 避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为, 公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章, 制订了《公平交易管理制度》、《异常交易监控管理制度》, 对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定, 并规定对买卖债券、股票时候的价格和市场价格差距较大, 可能存在利益输送、操纵股价等违法违规情况进行监控。

本报告期内，公平交易制度执行情况良好，报告期间未出现清算不到位的情况，本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未存在法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年，宏观经济方面，需求端继续下滑，地产和乘用车销量缓慢下行，棚改政策调整，对原本相对乐观的三四线城市地产投资增加了悲观情绪；物价方面，6 月 CPI 小幅回升至 1.9%，PPI 同比回升至 4.6%，黑色系工业品价格 6 月份冲高回落；消费方面，社会消费品零售实际增速、名义增速均创下 04 年以来新低；金融数据方面，社融超预期回落，表外融资持续收缩，同时受信用风险违约事件影响，债券融资规模减少。货币政策方面，一季度央行维持稳健中性、削峰填谷的操作，除通过普惠金融降准释放流动性外，跨春节期间通过临时准备金动用安排（CRA）缓解节前资金紧张，二季度资金利率在跨节、跨季期间明显好于预期，市场流动性也处于近一年多来最宽松期，降准叠加 MLF 操作，货币市场较为宽松，银行间市场资金利率、同业存单各期限利率较前期大幅下行，跨季资金在月末当天并未出现大幅飙升，临近尾盘结束，甚至出现减点出钱的情形。

债券市场方面，债券市场收益率曲线先上后下，悲观中走出一波较大的牛陡行情。1 月份，在经历了资金面极其紧张、存单收益率大幅上行的跨年后，债券市场迎来监管政策的陆续落地，央行 302 号文重拳规范债券代持、回购等业务，银监会发布《商业银行委托贷款管理办法》、《关于进一步深化整治银行业市场乱象的通知》，加上对资管新规落地的预期及油价上行带来的再通胀的扰动，债券市场悲观情绪升级，1 月中下旬 10 年期活跃券 170215 成交快速上行至 5.15%，10 年期国债收益率一度突破 4%，收益率高位震荡至 2 月份后，随着资金面宽松、同业存单发行利率大幅下行，跨春节资金并未如期紧张，加上股票市场也出现较大幅度的回调，债市悲观情绪得以修复，10 年期国开收益率下行至 4.8%，10 年期国债下行至 3.8%。3 月上旬，市场对通胀、跨季资金面、监管政策仍有担忧，利率债收益率在高位窄幅震荡，中下旬开始，传闻资管新规过渡期延长，同时存单利率大幅下行，全月募集量高达 2.2 万亿，超过到期量 1.8 万亿将近 4000 亿左右，同时中美贸易摩擦升级引发市场对基本面担忧，螺纹钢等工业品库存压力上升至高位，南华工业品指数跌幅扩大，基本面利好债券市场，10 年期国开急速下行 20bp 至 4.6%，10 年期国债下行 10bp 至 3.7% 附近。二季度债券市场收益率曲线跌宕起伏，季末伴随着资金面超预期宽松以及再次

降准来临，长端利率债大幅下行。4月中旬，央行宣布定向降准，债券市场压抑的情绪得到宣泄，机构配置杠杆抬升，国开活跃券在降准当日下行 22bp 至 4.3%，但随着下旬缴税开始，资金面异常紧张，隔夜飙升至 20%，同时受美债破 3% 带动，黑色系大涨等情绪因素影响，月末国开活跃券上行至 4.57%；5月初，信用违约事件频发，同时美债收益率最高上行至 3.12%，债券市场再次陷入悲观情绪，收益率曲线全月呈现倒 U 型，月中《商业银行流动性风险管理办法》发布，市场解读较为乐观，收益率曲线开启下行形态；6月份，月初经济数据依旧稳中向好，市场预期本月再次降准并未及时兑现，收益率小幅上行，中旬，金融数据公布，社融数据大幅低于预期，资金面宽松，存单收益率冲高回落，海外方面，美联储议息会议如期宣布加息，但央行并未跟随操作，债市情绪转暖，受中美贸易战再度激化影响，风险资产全线暴跌，6月24号，央行公布降准 0.5 个百分点，再现经济衰退中的抵抗式宽松操作，同时，月末资金宽松，存单收益率持续下行，债市做多情绪浓厚，长端利率债突破前期低点，国开与国债隐含税率、非国开与国开活跃券利差不断压缩，收益率曲线呈现牛陡趋势，10年期国开下行至 4.25%，10年期国债下行至 3.47%。信用债走势分化，中高等级走势明显好于低评级的，3年期 AAA 收益率由季度初 4.88% 下行至 4.55%，5年期 AAA 收益率由季度初 5.06% 下行至 4.65%。

权益市场，年初至今，市场走势可以分为以下四个阶段：1月初，A股受益于市场对 2018 年的乐观预期，开盘后持续冲高，上证综指从 3314 点上行至 3587 点。存量博弈的行情没有改变，并主要向金融、地产板块演绎，中小创进一步压制；2月伊始，美股回调引发全球股市动荡，两市急剧下挫，上证综指于 2月9日下跌至 3130 的低点；2月中旬至 4月底，A股经历短暂修复后便遭受了由美国发动的贸易战的第一轮冲击，仅操作系统国产化、芯片国产化、进口替代等与贸易战相关的少数板块表现活跃，除此之外整个市场表现低迷。在此之后市场利空消息频现，股指持续下落；5月至今，贸易摩擦由缓和到波澜再起，叠加 A 股入摩及 CDR 相关业务推进，市场整体进入箱体震荡格局，食品医药板块持续走强，沪指在 5月22日盘中达到高位 3214 点，而后调整下行。回顾 2018 上半年，宏观经济相对韧性情况下，市场震荡走弱主要源于风险扰动因素增多。外部因素的中美贸易战对应着国际地位之争，非一朝一夕能够解决。内部因素中独角兽上市、信用风险是市场的关注焦点，与监管层态度息息相关。本着债券为主、权益增强的稳健策略，在高等级信用债收益率回升幅度较大、已经提供了较高安全垫的基础上，适度提高债券组合配置比例，增持 3 到 5 年期的高等级信用债，拉长组合久期，通过长久期利率债进行波段交易操作。权益操作上，鉴于当前处于短周期衰退期的判断，权益仓位一直维持低位，结构上以消费类股票为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国开开泰混合 A 基金份额净值为 1.0093 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.26%；截至本报告期末国开开泰混合 C 基金份额净值为 1.0028 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.05%；同期业绩比较基准收益率为-0.58%。

#### 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、货币政策方面，宏观审慎框架下的监管政策陆续落地，金融去杠杆初见成效，去杠杆逐渐过渡到稳杠杆阶段，上半年央行通过三次降准对冲 MLF 到期，目前 MLF 到期仍有 4.8 万亿，预计今年下半年将有一到两次降准空间，在边际宽松的货币政策空间下，银行负债端压力逐步缓解，同业存单发行利率有望持续下调，但受制于外围美联储加息缩表以及人民币汇率贬值压力，在降准的同时央行可能再度提高公开市场操作利率，保证市场资金的合理充裕的同时防止金融机构过渡加杠杆。

二、宏观经济方面，预计下半年宏观经济小幅下行，全年 GDP 在 6.5%附近，具体来看，需求端，房地产和汽车销售数据双双走弱，棚改货币化政策调整，三四线房地产支撑力度减弱，同时一二线城市房地产政策未见放松，另外，2018 年地产债大量到期及回售，中小地产企业负债压力加大，预计下半年地产和汽车销售数据仍将下行；基建方面，上半年受制于地方债发行缓慢等因素，基建并未发力，下半年，伴随着央行降准以及银行负债端压力减弱，预计下半年基建将好于上半年；进出口方面，受中美贸易战影响，预计贸易顺差将大幅收窄。

三、债券市场，短端利率方面，预计下半年央行仍有一到两次降准，银行负债端压力减弱，同业存单量缩价降，但短端利率受制于美联储加息以及人民币贬值影响，不排除央行将会再次上调公开市场操作利率。长端利率债，上半年债券市场长端利率债收益率震荡下行，预计下半年收益率曲线仍有下行空间，延续上半年走势，在悲观预期-预期差修正中呈现窄幅回调-下行趋势。信用债方面，前期受宏观经济下行以及前期资金面悲观影响，市场青睐高等级信用债，低等级信用利差位于历史高位，下半年伴随着资金面宽松，社融和贷款回升，预计部分有业绩压力的机构会逐渐采用信用下沉策略。因此，下半年债券配置，我们倾向于相对积极的策略，以长久期、高等级择时配置，同时少量仓位配置短久期、高票息债券，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。

四、权益市场，从短周期看当前仍处于衰退期，资产配置上以持有高等级债券为主，权益市场继续看空。但是，随着股票市场大幅下跌，A 股的估值水平已经处于历史低位附近，股票市场向下空间已经非常有限；而且，当前的货币政策已经边际宽松，随后将迎来领先指标（货币类指标）触底，市场将进入衰退后期，权益市场将迎来多头市场，至少有可参与的结构性的机会。我们将持续跟踪分析国内外宏观经济的变化，以此确定合理的权益操作策略，结合账户以追求绝对收

益为目标的特征，积极主动调整权益资产仓位和结构，争取为持有人获取良好回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

###### 4.6.1.1 职责分工

参与估值小组成员为 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

报告期内，本基金进行了一次利润分配，情况如下：

本基金于 2018 年 6 月 25 日发布分红公告，A 类按每 10 份基金份额派发红利 0.4900 元，其中现金形式发放总额 2,754.09 元，再投资形式发放总额 491,556.91 元；C 类按每 10 份基金份额派发红利 0.4900 元，其中现金形式发放总额 9,899,629.09 元，再投资形式发放总额 148.46 元；本次分红总金额为 10,394,088.55 元，权益登记日为 2018 年 6 月 27 日。

本基金本报告期内共计派发红利 10,394,088.55 元，报告期内已无应分配但未分配利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行股份有限公司严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对国开开泰混合基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在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公司在国开开泰混合基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国开泰富基金管理有限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国开开泰混合基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,563,113.59	761,543.97
结算备付金		27,691.48	373,928.97
存出保证金		12,884.58	18,748.63
交易性金融资产	6.4.7.2	258,709,503.41	280,320,076.80
其中：股票投资		5,212,116.21	12,864,100.00
基金投资		-	-
债券投资		253,497,387.20	267,455,976.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	360,806.76
应收利息	6.4.7.5	5,170,087.20	3,994,362.78
应收股利		-	-
应收申购款		1,010.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		268,484,290.26	285,829,467.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		54,789,617.61	65,337,701.99
应付证券清算款		2,688.00	337,029.89
应付赎回款		19.50	10.29
应付管理人报酬		109,568.83	112,175.68
应付托管费		27,392.22	28,043.93
应付销售服务费		69,538.19	71,204.02
应付交易费用	6.4.7.7	62,713.74	173,823.49
应交税费		34,599.14	-
应付利息		23,716.38	43,132.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	81,400.01	155,000.00
负债合计		55,201,253.62	66,258,121.57
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	212,613,300.10	212,983,843.28
未分配利润	6.4.7.10	669,736.54	6,587,503.06
所有者权益合计		213,283,036.64	219,571,346.34
负债和所有者权益总计		268,484,290.26	285,829,467.91

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，国开开泰混合 A 基金份额净值 1.0093 元，基金份额总额 10,575,876.88 份；国开开泰混合 C 基金份额净值 1.0028 元，基金份额总额 202,037,423.22 份。国开开泰混合份额总额合计为 212,613,300.10 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至
-----	-----	----------------------------	----------------------------

		年 6 月 30 日	2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		7,012,483.85	6,432,669.89
1.利息收入		6,695,814.89	5,328,545.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,091.20	978,569.28
债券利息收入		6,686,406.11	3,963,338.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,317.58	386,637.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-879,360.16	385,513.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-842,941.49	385,116.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-72,134.75	397.02
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	35,716.08	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,195,222.09	718,253.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	807.03	357.59
<b>减：二、费用</b>		2,508,885.59	1,963,925.64
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	659,513.75	677,431.34
2. 托管费	6.4.9.2.2	164,878.42	169,357.86
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	418,636.19	430,848.37
4. 交易费用	6.4.7.19	78,476.76	37,428.34
5. 利息支出		1,073,077.93	551,705.07
其中：卖出回购金融资产支出		1,073,077.93	551,705.07
6. 税金及附加		18,006.18	-
7. 其他费用	6.4.7.20	96,296.36	97,154.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,503,598.26	4,468,744.25
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,503,598.26	4,468,744.25

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	212,983,843.28	6,587,503.06	219,571,346.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,503,598.26	4,503,598.26
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）	-370,543.18	-27,276.23	-397,819.41
其中：1.基金申购款	689,723.24	14,449.57	704,172.81
2.基金赎回款	-1,060,266.42	-41,725.80	-1,101,992.22
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）	-	-10,394,088.55	-10,394,088.55
五、期末所有者权益（基金净值）	212,613,300.10	669,736.54	213,283,036.64
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
项目	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）	230,510,231.52	102,813.66	230,613,045.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,468,744.25	4,468,744.25
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）	-9,633,766.47	-71,317.47	-9,705,083.94
其中：1.基金申购款	1,586,845.32	7,410.77	1,594,256.09
2.基金赎回款	-11,220,611.79	-78,728.24	-11,299,340.03
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	220,876,465.05	4,500,240.44	225,376,705.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨波</u>	<u>朱瑜</u>	<u>姚劼</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金(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[2016]1234号《关于准予国开泰富开泰灵活配置混合型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《国开泰富开泰灵活配置混合型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 230,496,791.50 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(2016)第 883 号予以验证。经向中国证监会备案,《国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 230,510,231.52 份基金份额,其中认购资金利息折合 13,440.02 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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金分设两类基金份额:A 类基金份额和 C 类基金份额。收取认/申购费及赎回费,但不收取销售服务费的基金份额类别称为 A 类基金份额;不收取认/申购费,但收取赎回费及销售服务费的基金份额类别称为 C 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码,两类基金份额收取不同的认/申购费、赎回费及销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、货币市场工具、权证、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%;权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数

收益率 X 30% + 中债总财富(总值)指数收益率 X 70%。

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 08 月 25 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金 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。本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资和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,并以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

## (2) 金融负债的分类

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

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

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

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，每一基金份额享有同等分配权。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据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，本基金确定以下类别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：

（1）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2018 年 6 月 30 日
活期存款	4,563,113.59
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,563,113.59

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,307,014.19	5,212,116.21	-94,897.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	75,387.20	19,387.20
	银行间市场	253,422,000.00	-1,749,894.38
	合计	253,497,387.20	-1,730,507.18
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	260,534,908.57	258,709,503.41	-1,825,405.16

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产无期末余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易，也无在买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	232.91
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	12.50
应收债券利息	5,169,835.99
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5.80
合计	5,170,087.20

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	45,786.08
银行间市场应付交易费用	16,927.66
合计	62,713.74

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.01
预提费用	81,400.00
合计	81,400.01

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国开开泰混合 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,119,317.01	10,119,317.01
本期申购	561,756.50	561,756.50
本期赎回(以“-”号填列)	-105,196.63	-105,196.63
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	10,575,876.88	10,575,876.88

国开开泰混合 C		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	202,864,526.27	202,864,526.27
本期申购	127,966.74	127,966.74
本期赎回(以"-"号填列)	-955,069.79	-955,069.79
- 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	202,037,423.22	202,037,423.22

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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国开开泰混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	496,679.90	-142,329.49	354,350.41
本期利润	178,602.68	57,624.61	236,227.29
本期基金份额交易产生的变动数	6,923.16	-4,372.09	2,551.07
其中：基金申购款	13,171.93	-5,368.00	7,803.93
基金赎回款	-6,248.77	995.91	-5,252.86
本期已分配利润	-494,311.00	-	-494,311.00
本期末	187,894.74	-89,076.97	98,817.77

国开开泰混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,075,336.80	-2,842,184.15	6,233,152.65
本期利润	3,129,773.49	1,137,597.48	4,267,370.97
本期基金份额交易产生的变动数	-38,982.36	9,155.06	-29,827.30
其中：基金申购款	6,765.60	-119.96	6,645.64
基金赎回款	-45,747.96	9,275.02	-36,472.94
本期已分配利润	-9,899,777.55	-	-9,899,777.55
本期末	2,266,350.38	-1,695,431.61	570,918.77

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	1,118.73
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	802.07
其他	170.40
合计	2,091.20

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	30,204,090.03
减：卖出股票成本总额	31,047,031.52
买卖股票差价收入	-842,941.49

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	-72,134.75
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	-72,134.75

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	265,315,969.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	259,800,518.72
减：应收利息总额	5,587,585.77
买卖债券差价收入	-72,134.75

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	35,716.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	35,716.08

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	1,195,222.09
——股票投资	40,628.54
——债券投资	1,154,593.55
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,195,222.09

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日

基金赎回费收入	807.03
合计	807.03

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	73,051.76
银行间市场交易费用	5,425.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	78,476.76

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	32,728.42
信息披露费	39,671.58
银行划款费用	5,296.36
银行间帐户维护费	18,600.00
合计	96,296.36

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国开泰富基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国开证券股份有限公司	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。

#### 6.4.9 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通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

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股票交易。

#### 6.4.9.1.2 债券交易

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债券交易。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

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权证交易。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	659,513.75	677,431.34
其中：支付销售机构的客户维护费	6,470.44	6,878.86

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	164,878.42	169,357.86

#### 6.4.9.2.3 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		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国开开泰混合A	国开开泰混合C	合计
国开泰富基金管理有限责任公司	-	418,425.68	418,425.68
中信银行股份有限公司	-	44.51	44.51
国开证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	418,470.19	418,470.19
获得销售服务费的	上年度可比期间		

各关联方名称	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国开开泰混合A	国开开泰混合C	合计
国开泰富基金管理有限责任公司	-	430,152.17	430,152.17
中信银行股份有限公司	-	43.97	43.97
国开证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	430,196.14	430,196.14

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，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。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 X 0.40% / 当年天数。

#### 6.4.9.3 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。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未持有本基金。

#### 6.4.9.5 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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	4,563,113.59	1,118.73	124,109.74	978,569.28

#### 6.4.9.6 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。

#### 6.4.9.7 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。

#### 6.4.10 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.10.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.10.2 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
000796	凯撒旅游	2018年1月19日	临时停牌	12.90	-	-	37,000	493,911.00	477,300.00	-

### 6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2018 年 06 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 54,789,617.61，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
130434	13 农发 34	2018 年 7 月 2 日	100.87	200,000	20,174,000.00
101754076	17 赣高速 MTN001	2018 年 7 月 5 日	100.55	100,000	10,055,000.00
101800409	18 闽投 MTN001	2018 年 7 月 5 日	100.27	55,000	5,514,850.00
101800662	18 京能源 MTN001	2018 年 7 月 5 日	100.72	200,000	20,144,000.00
合计				555,000	55,887,850.00

#### 6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

### 6.4.11 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 2018 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一层次的余额为 4,810,203.41 元，第二层次的余额为 253,899,300.00 元，无属于第三层次的余额。于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负

债。

(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 2018 年 06 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。

(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。

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

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5, 212, 116. 21	1. 94

	其中：股票	5,212,116.21	1.94
2	固定收益投资	253,497,387.20	94.42
	其中：债券	253,497,387.20	94.42
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,590,805.07	1.71
7	其他各项资产	5,183,981.78	1.93
8	合计	268,484,290.26	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,892,014.21	1.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	705,246.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	184,800.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	275,326.00	0.13
K	房地产业	534,080.00	0.25
L	租赁和商务服务业	477,300.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	143,350.00	0.07
S	综合	-	-

	合计	5,212,116.21	2.44
--	----	--------------	------

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有按行业分类的沪港通投资股票投资组合。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600196	复星医药	12,939	535,545.21	0.25
2	000796	凯撒旅游	37,000	477,300.00	0.22
3	000963	华东医药	9,000	434,250.00	0.20
4	603630	拉芳家化	16,800	317,520.00	0.15
5	000538	云南白药	2,700	288,792.00	0.14
6	000651	格力电器	6,000	282,900.00	0.13
7	600779	水井坊	5,000	276,150.00	0.13
8	601318	中国平安	4,700	275,326.00	0.13
9	600048	保利地产	22,000	268,400.00	0.13
10	000002	万科A	10,800	265,680.00	0.12

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	1,380,176.00	0.63
2	600196	复星医药	1,103,969.39	0.50
3	300182	捷成股份	704,710.00	0.32
4	603630	拉芳家化	653,580.00	0.30
5	300122	智飞生物	604,240.00	0.28
6	002304	洋河股份	532,890.00	0.24
7	000568	泸州老窖	517,672.00	0.24
8	300296	利亚德	513,097.00	0.23
9	600809	山西汾酒	479,645.00	0.22
10	002508	老板电器	473,216.00	0.22
11	600779	水井坊	460,000.00	0.21
12	000869	张裕A	453,720.00	0.21
13	002456	欧菲光	387,820.00	0.18

14	600691	阳煤化工	380,600.00	0.17
15	603027	千禾味业	367,973.00	0.17
16	000963	华东医药	354,181.00	0.16
17	000063	中兴通讯	345,470.00	0.16
18	000968	*ST 煤气	342,880.00	0.16
19	002439	启明星辰	338,887.00	0.15
20	603799	华友钴业	330,357.00	0.15

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000977	浪潮信息	2,114,065.00	0.96
2	600887	伊利股份	1,400,730.00	0.64
3	002415	海康威视	972,526.00	0.44
4	600699	均胜电子	800,542.00	0.36
5	601688	华泰证券	688,436.00	0.31
6	600362	江西铜业	681,420.00	0.31
7	300298	三诺生物	643,800.00	0.29
8	300182	捷成股份	641,945.00	0.29
9	600366	宁波韵升	641,826.00	0.29
10	300122	智飞生物	634,720.22	0.29
11	000625	长安汽车	598,380.00	0.27
12	600196	复星医药	579,890.00	0.26
13	002304	洋河股份	576,130.00	0.26
14	000967	盈峰环境	575,126.32	0.26
15	000050	深天马 A	548,697.00	0.25
16	300296	利亚德	544,485.00	0.25
17	002640	跨境通	534,184.00	0.24
18	601888	中国国旅	526,760.00	0.24
19	600655	豫园股份	512,520.00	0.23
20	000968	*ST 煤气	494,073.00	0.23

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,354,419.19
卖出股票收入（成交）总额	30,204,090.03

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,430,000.00	14.27
	其中：政策性金融债	30,430,000.00	14.27
4	企业债券	14,062,000.00	6.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	208,930,000.00	97.96
7	可转债（可交换债）	75,387.20	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	253,497,387.20	118.85

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	101800016	18 中化工 MTN001	200,000	20,420,000.00	9.57
2	101353014	13 太钢 MTN001	200,000	20,214,000.00	9.48
3	130434	13 农发 34	200,000	20,174,000.00	9.46
4	101800662	18 京能源 MTN001	200,000	20,144,000.00	9.44
5	101800409	18 闽投 MTN001	200,000	20,054,000.00	9.40

## 7.7 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

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货，也无期间损益。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期没有进行股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期没有进行国债期货投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期没有进行国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 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、出发的情形。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 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	12,884.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,170,087.20
5	应收申购款	1,010.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,183,981.78

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有转股期可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000796	凯撒旅游	477,300.00	0.22	停牌

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
国开 开泰 混合 A	101	104,711.65	10,485,303.72	99.14%	90,573.16	0.86%
国开 开泰 混合 C	240	841,822.60	200,012,009.49	99.00%	2,025,413.73	1.00%
合计	341	623,499.41	210,497,313.21	99.00%	2,115,986.89	1.00%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	国开开泰混合 A	119.76	0.0001%
	国开开泰混合 C	147.97	0.0001%
	合计	267.73	0.0001%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本报告期末本基金基金经理、公司高级管理人员、投资和部门负责人未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国开开泰混 合 A	国开开泰混 合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 27 日）基金份额总额	10,477,584.47	220,032,647.05
本报告期期初基金份额总额	10,119,317.01	202,864,526.27
本报告期基金总申购份额	561,756.50	127,966.74
减：本报告期基金总赎回份额	105,196.63	955,069.79
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	10,575,876.88	202,037,423.22

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经国开泰富基金管理有限责任公司第二届董事会第十五次会议审议通过，岳斌同志为国开泰富基金管理有限责任公司督察长人选，在取得中国证券监督管理委员会北京监管局无异议文件后，自 2018 年 5 月 15 日起任国开泰富基金管理有限责任公司督察长。国开泰富基金管理有限责任公司督察长肖强同志自 2018 年 5 月 14 日起离任。

经国开泰富基金管理有限责任公司第二届董事会第十七次（临时）会议审议通过，杨波同志

为国开泰富基金管理有限责任公司总经理人选，在完成监管部门报备后，自 2018 年 6 月 12 日起任国开泰富基金管理有限责任公司总经理，任期三年。在杨波先生任职事项于监管部门完成报备之前，公司总经理任职暂由公司副总经理朱瑜女士代为履行。

上述事项已报监管部门备案。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，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）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	34,829,693.29	65.03%	24,774.36	65.03%	-
招商证券	2	11,430,815.61	21.34%	8,130.87	21.34%	-
信达证券	2	7,298,000.32	13.63%	5,191.05	13.63%	-

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	200,012,000.00	0.00	0.00	200,012,000.00	94.07%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金为混合基金，风险等级为中高级，单一投资者持有的份额比例过于集中达到或超过 20%，存在潜在流动性风险和集中赎回风险。但公司对该基金拥有完全自主投资决策权，报告期间严格按照法规和基金合同规定合规运作，严控流动性风险，单一投资者赎回本基金不会给本基金带来显著的流动性风险。因基金单位净值最末位小数致四舍五入的原因，单一投资者赎回本基金可能给存续投资者带来一定程度的净值损失。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2018 年 6 月 12 日，杨波先生正式任职公司总经理职务。

2018 年 5 月 30 日，王婷婷增聘为国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金及国开泰富货币市场证券投资基金基金经理。

2018 年 6 月 5 日，洪宴解聘国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

2018 年 6 月 19 日，何玄文增聘为国开泰富开泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

国开泰富基金管理有限责任公司  
2018 年 8 月 25 日