

国开泰富货币市场证券投资基金 2018 年年度报告

2018 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：2019 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 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 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 债券回购融资情况.....	48
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	48
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.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49

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	49
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	50
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	50
8.9 投资组合报告附注	50
§9 基金份额持有人信息	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	51
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§10 开放式基金份额变动	52
§11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	54
11.9 其他重大事件	54
§12 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§13 备查文件目录	56
13.1 备查文件目录	56
13.2 存放地点	56
13.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国开泰富货币市场证券投资基金	
基金简称	国开货币	
基金主代码	000901	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 1 月 14 日	
基金管理人	国开泰富基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	189,321,313.34 份	
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	100,001,598.81 份	89,319,714.53 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	岳斌	贺倩
	联系电话	010-59363088	010-66060069
	电子邮箱	yuebin@cdbsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-59363299	95599
传真		010-59363220	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 号
办公地址		北京市西城区西直门南小街	北京市西城区复兴门内大街 28

	国英园 9 号楼	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100035	100031
法定代表人	郑文杰	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cdbsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	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
注册登记机构	国开泰富基金管理有限责任公司	北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼

§ 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

3.1.1 期间 数据 和指 标	2018 年		2017 年		2016 年	
	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	4,866,422.66	6,561,948.82	8,618,879.23	9,331,599.69	4,430,860.45	10,416,537.65
本期 利润	4,866,422.66	6,561,948.82	8,618,879.23	9,331,599.69	4,430,860.45	10,416,537.65
本期 净值 收益率	3.4607%	3.7098%	3.8879%	4.1376%	2.9925%	3.2396%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	期末	100,001,598.81	89,319,714.53	186,858,927.62	252,795,739.40	188,884,267.13

基金资产净值						
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
累计净值收益率	14.5377%	15.6349%	10.7064%	11.4985%	6.5633%	7.0684%

金额单位：人民币元

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	0.6619%	0.0045%	0.3403%	0.0000%	0.3216%	0.0045%
过去六个月	1.4863%	0.0046%	0.6805%	0.0000%	0.8058%	0.0046%
过去一年	3.4607%	0.0057%	1.3500%	0.0000%	2.1107%	0.0057%
过去三年	10.6997%	0.0085%	4.0537%	0.0000%	6.6460%	0.0085%
自基金合同生效起至今	14.5377%	0.0102%	5.3556%	0.0000%	9.1821%	0.0102%

国开货币 B

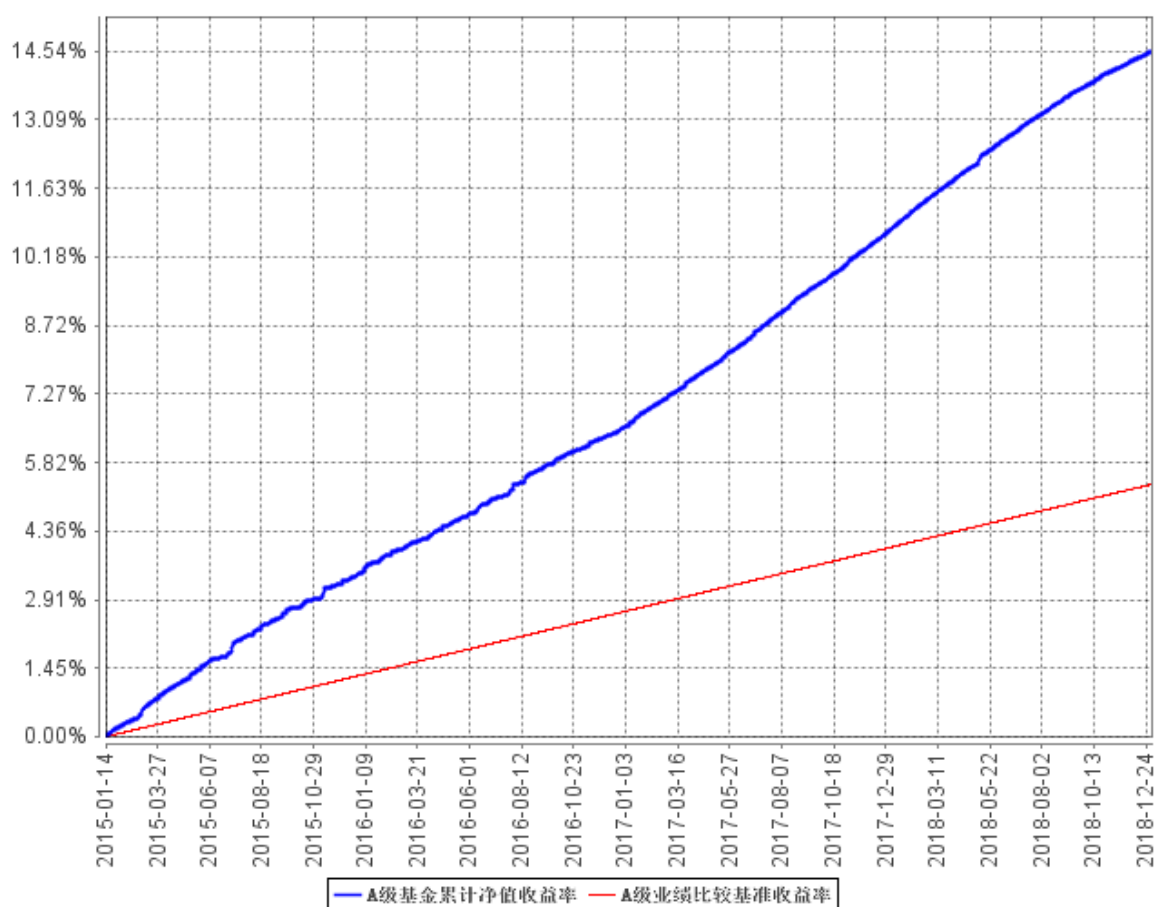
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7228%	0.0045%	0.3403%	0.0000%	0.3825%	0.0045%

过去六个月	1.6095%	0.0046%	0.6805%	0.0000%	0.9290%	0.0046%
过去一年	3.7098%	0.0057%	1.3500%	0.0000%	2.3598%	0.0057%
过去三年	11.4997%	0.0085%	4.0537%	0.0000%	7.4460%	0.0085%
自基金合同生效起至今	15.6349%	0.0102%	5.3556%	0.0000%	10.2793%	0.0102%

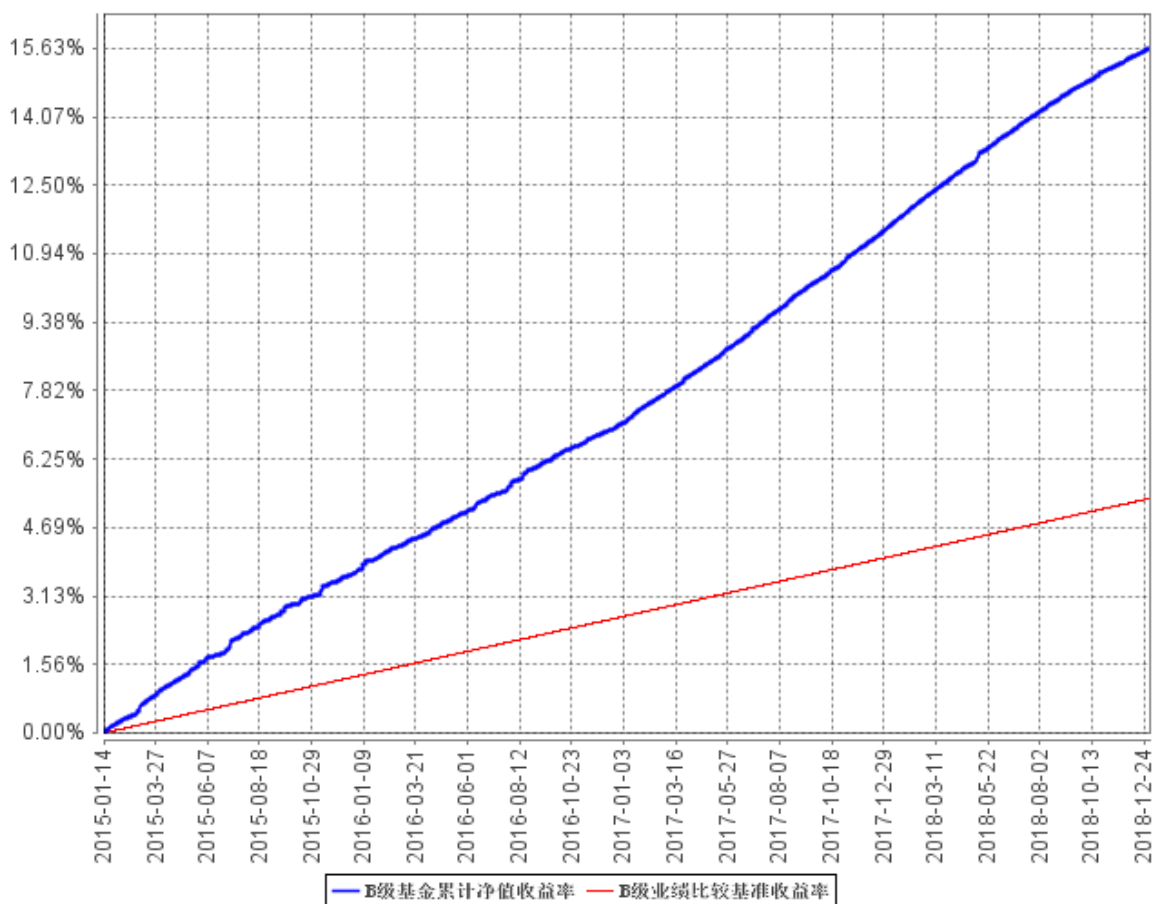
注：本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）。

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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

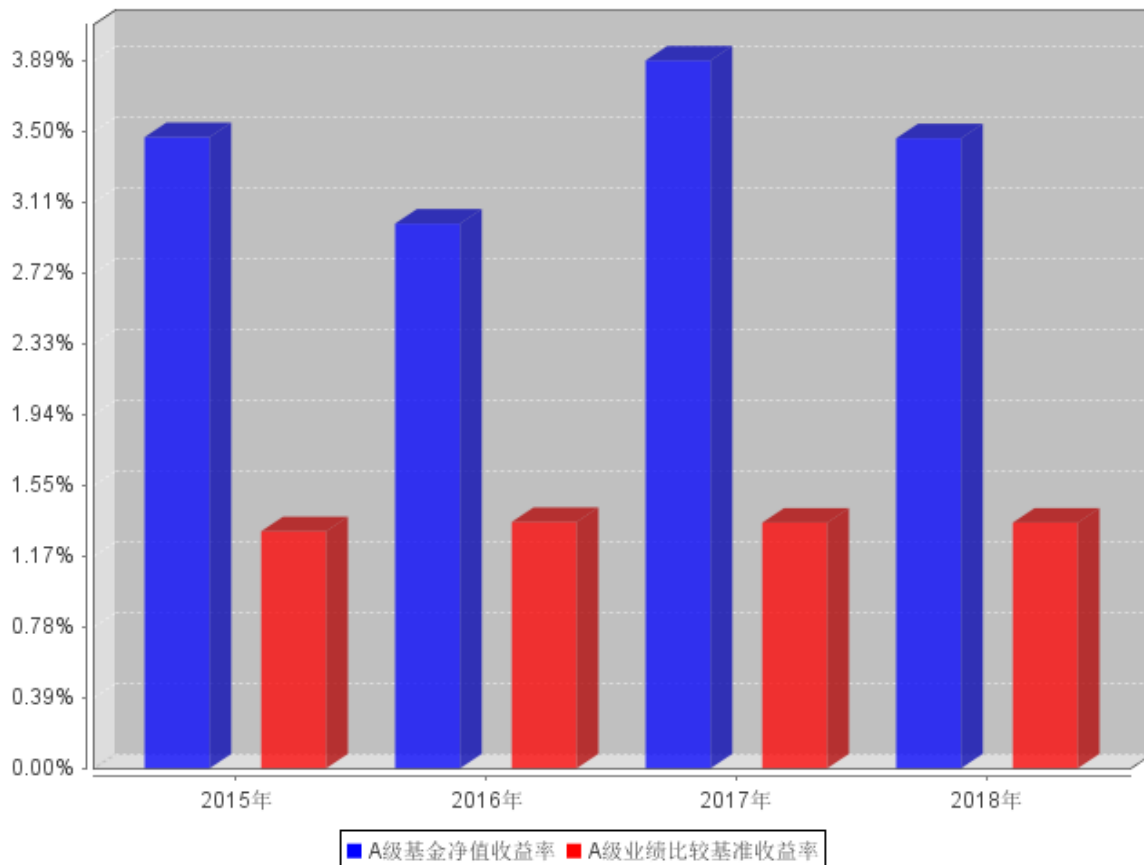


注：1、本基金业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）；

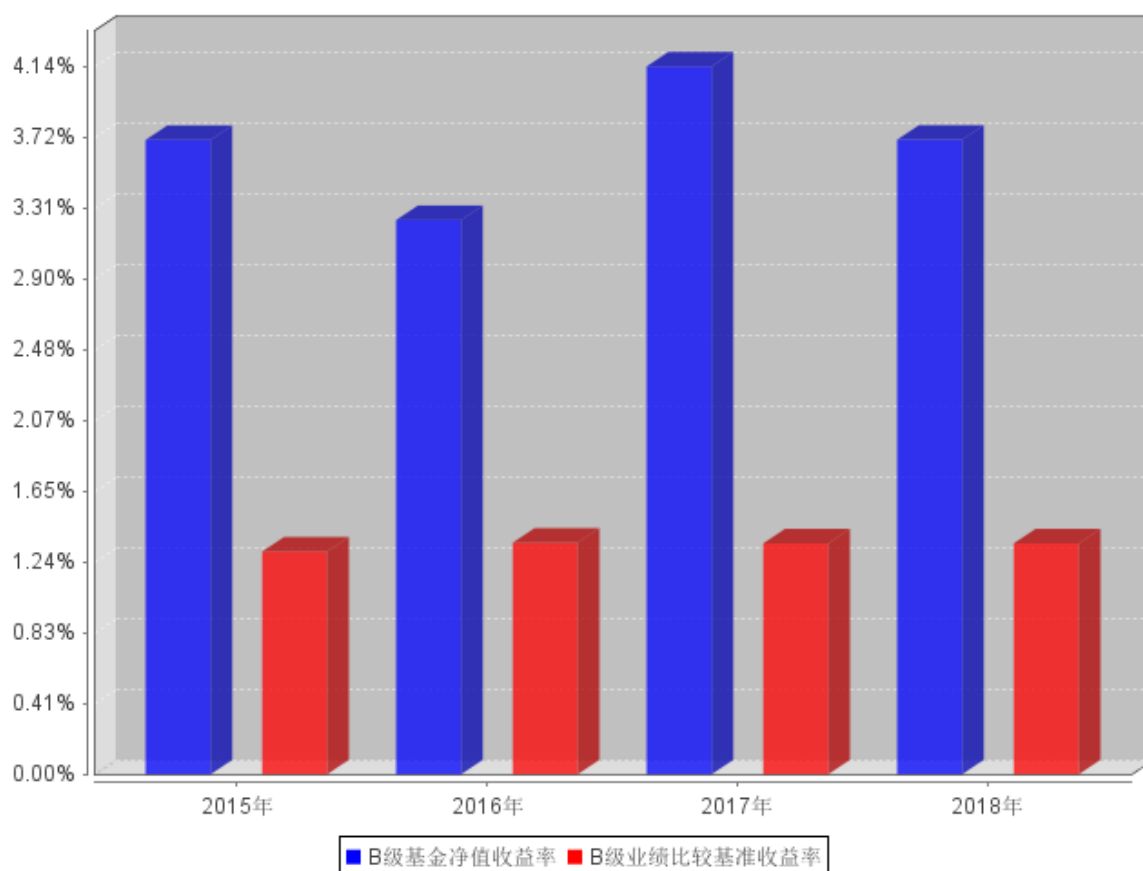
2、本基金基金合同于 2015 年 1 月 14 日生效，至本报告期末未满 1 年。按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

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

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 1 月 14 日，2015 年度的相关数据根据当年实际存续期（2015 年 1 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日）计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国开货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	4,902,653.68	-	-36,231.02	4,866,422.66	
2017	8,577,820.49	-	41,058.74	8,618,879.23	
2016	4,409,763.61	-	21,096.84	4,430,860.45	
合计	17,890,237.78	-	25,924.56	17,916,162.34	

单位：人民币元

国开货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	6,626,771.28	-	-64,822.46	6,561,948.82	
2017	9,305,486.02	-	26,113.67	9,331,599.69	

2016	10,356,669.70	-	59,867.95	10,416,537.65	
合计	26,288,927.00	-	21,159.16	26,310,086.16	

§ 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 12 月 31 日，公司旗下管理 4 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、国开泰富睿富债券型证券投资基金。同时，公司还管理多个特定客户资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王婷婷	本基金基金经理	2017 年 3 月 27 日	-	8 年	王婷婷女士，固定收益投资部基金经理，硕士。现任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及国开泰富睿富债券型证券投资基金基金经理。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；持有国家法律职业资格、银行间市场本币交易员资格、证券从业资格和会计从业资格。

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为，公司根据《证券投资基金法》、《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

2018 年，宏观经济方面，库存周期逐步由被动去库存过渡至主动去库存，工业产出以及房地产销售、固定资产投资、居民消费均有所放缓；物价方面，原油价格连续大幅下行拖累成品油和工业品价格，食品类价格虽呈上涨趋势，但涨幅均较为缓和，近期市场观点逐步由通胀担忧转移至通缩担忧；金融数据方面，宽货币到宽信用传导不畅，金融数据延续下行趋势，社融同比增速降至 10% 以下，M2 增速企稳，但 M1 增速仍在回落中。央行货币政策方面，为进一步支持实体经济发展，优化商业银行和金融市场的流动性结构，降低融资成本，央行从 2018 年 10 月 15 日起，下调大型商业银行、股份制商业银行、城市商业银行、非县域农村商业银行、外资银行人民币存款准备金率 1 个百分点，同时央行加大对民企融资扶持力度，成立民企债券融资支持工具，增加民企再贷款和再贴现额度，发挥定向调控、精准滴灌功能，积极支持商业银行等机构，运用信用风险缓释工具支持民企债券融资。2018 年资金面整体平稳，临近年末，年内资金供给充足，跨年资金价格抬升，同业存单价格在 12 月末最后一周大幅提价。

债券市场方面，2018 年初债券市场情绪仍弥漫在 2017 年度去杠杆政策的阴霾下，收益率曲线在年初再次飙升，随后在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，收益率曲线全年呈现倒 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重向好，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%；7 月下旬至 8 月底，国务院常务会议召开，提及扩大内需以及央行鼓励购买低等级信用债，宽货币宽信用格局确认，长端利率债回调；9 月，通胀数据略超预期，市场对滞涨有所预期，长端利率债几乎在本月处于横盘走势，9 月末宏观数据放缓，同时央行未跟随美联储加息，债券市场情绪转暖；10 月国庆节最后一天，央行降准 1%，释放 1.2 万亿流动性，10 月中旬受美股大跌影响，A 股盘中创 2016 年以来新低，国债期货受避险情绪影响，大幅拉升，现券收益率跟随下行；11 月金融数据社融增速大降，宽信用政策未见效，M1 同比降至 2.7%，信用创造低迷，债券市场收益率迅速下行；12 月月中，受地产政策放松传闻影响，债券市场收益率小幅回调，但伴随着跨年资金宽松以及央行创设 TMLF 等政策，收益率在回调后再次下调，全年十年期国开收益率曲线从 4.87% 下行至 3.64%，十年期国债收益率曲线从 3.9% 下行至 3.22%。

本基金密切关注市场流动性变化，在《公募基金流动性风险管理规定》的规范下，调整组合久期以及流动性比例，针对货币市场及短期债券市场出现的新情况，及时调整策略，在平衡日常申赎流动性的基础上，适当调整久期，适当增配较长期限的高等级信用债及同业存单。同时着重提前应对缓解春节、季末等特殊时点的资金压力，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

本报告期国开货币 A 的基金份额净值收益率为 3.4607%，本报告期国开货币 B 的基金份额净值收益率为 3.7098%，同期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

货币政策方面，2019 年央行仍将实行稳健的货币政策，坚持稳中求进总基调，大概率仍维持流动性充裕、削峰填谷的操作，宽货币逐步扩展至宽信用，预计 2019 年仍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，防止市场资金的过渡充裕的同时防止金融机构过渡加杠杆。

宏观经济方面，预计 2019 年宏观经济仍将小幅下行，全年 GDP 在 6.3%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，2019 年地产债大量到期及回售，中小地产企业负债压力加大，预计地产和汽车销售数据仍将下行；基建方面，地方政府债加速推进发行，基建触底反弹；进出口方面，受中美贸易战影响，预计贸易顺差继续收窄。

债券市场，短端利率目前已接近历史低位，同业存单收益率大幅下行，预计 2019 年短端资金利率进一步下行空间不大，长端利率债方面，十年国债及国开均已近历史低位，进一步下行突破 2016 年低点概率不大，2019 年宽货币逐步向宽信用传导，央行不断出台信用派生政策，刺激银行放贷，金融数据预计将触底反弹，但 2019 年经济下行压力仍大，因此，长端利率债上行空间亦不大。债券配置方面，我们倾向于票息策略，以高等级票息则是配置，同时通过利率债进行波段操作。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部门、风险控制部门定期与不定期的对基金的投资、研究、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的合规审核及监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；通过信息技术建立多级投资交易预警系统；完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；根据新出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和业务流程；加强法律法规的教育和培训，促进公司合规文化的建设；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、当地证监局和公司董事会。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7.1.1 职责分工

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

部负责人担任。

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

4.7.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

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

4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.7.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国开泰富基金管理有限责任公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，国开泰富基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、

基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国开泰富基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字（2019）第 21660 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 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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	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

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇 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	2019 年 3 月 28 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: 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	115,258.63	48,552.55
结算备付金		-	36,363.64

存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	179,126,109.42	392,995,498.79
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		179,126,109.42	392,995,498.79
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	36,000,294.00	57,090,445.64
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	959,728.40	2,042,710.34
应收股利		-	-
应收申购款		62,200.00	776,810.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		216,263,590.45	452,990,380.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		26,399,760.40	12,572,741.14
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		52,505.68	121,720.16
应付托管费		15,910.78	36,884.88
应付销售服务费		22,837.34	47,781.52
应付交易费用	7.4.7.7	19,120.86	21,495.49
应交税费		1,835.12	-
应付利息		14,657.44	18,387.78
应付利润		56,649.49	157,702.97
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	359,000.00	359,000.00
负债合计		26,942,277.11	13,335,713.94
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	189,321,313.34	439,654,667.02
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		189,321,313.34	439,654,667.02
负债和所有者权益总计		216,263,590.45	452,990,380.96

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 189,321,313.34 份，其中国开货币 A 类基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 100,001,598.81 份，国开货币 B 类基金

份额净值 1.00 元，基金份额总额 89,319,714.53 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		14,203,389.07	22,511,436.33
1.利息收入		13,491,267.16	22,108,722.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,145.64	468,939.78
债券利息收入		11,206,262.59	18,287,447.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,281,858.93	3,352,335.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		712,121.91	402,714.20
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	712,121.91	402,714.20
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		2,775,017.59	4,560,957.41
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,053,153.98	1,538,324.70
2. 托管费	7.4.10.2.2	319,137.58	466,158.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	370,949.94	596,879.52
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		592,423.74	1,515,775.83
其中：卖出回购金融资产支出		592,423.74	1,515,775.83
6. 税金及附加		8,327.34	-
7. 其他费用	7.4.7.20	431,025.01	443,818.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,428,371.48	17,950,478.92
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,428,371.48	17,950,478.92
-------------------	--	---------------	---------------

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	439,654,667.02	-	439,654,667.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,428,371.48	11,428,371.48
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）	-250,333,353.68	-	-250,333,353.68
其中：1. 基金申购款	803,542,236.41	-	803,542,236.41
2. 基金赎回款	-1,053,875,590.09	-	-1,053,875,590.09
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）	-	-11,428,371.48	-11,428,371.48
五、期末所有者权益（基金净值）	189,321,313.34	-	189,321,313.34
项目	上年度可比期间 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

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：

_____ 杨波 _____	_____ 朱瑜 _____	_____ 姚劼 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国开泰富货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 1145 号《关于准予国开泰富货币市场证券投资基金注册的批复》核准,由国开泰富基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,333,674,918.07 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 014 号予以验证。经向中国证监会备案,《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》于 2015 年 1 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,334,110,479.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 435,561.10 份基金份额。本基金的基金管理人为国开泰富基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》和《国开泰富货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据基金份额持有人持有本基金份额的数量进行基金份额类别划分。本基金设 A 类和 B 类两类基金份额,两类基金份额按照不同的费率计提销售服务费,两类基金份额单独设置基金代码,并单独公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;中国证监会及/或中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国开泰富货币市场证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.9 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为基金份额持有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，为基金份额持有人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为基金份额持有人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日基金份额持有人不记收益；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，基金份额持有人可通过赎回基金份额获得现金收益；若基金份额持有人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为基金份额持有人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减基金份额持有人基金份额。若基金份额持有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，则从基金份额持有人赎回基金款中扣除。

7.4.4.11 分部报告

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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于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。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[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》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	115,258.63	48,552.55
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	115,258.63	48,552.55

注：定期存款的存款期限指票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	179,126,109.42	179,269,000.00	142,890.58	0.0755%
	合计	179,126,109.42	179,269,000.00	142,890.58	0.0755%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	179,126,109.42	179,269,000.00	142,890.58	0.0755%
项目		上年度末 2017 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	392,995,498.79	392,859,500.00	-135,998.79	-0.0309%
	合计	392,995,498.79	392,859,500.00	-135,998.79	-0.0309%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	392,995,498.79	392,859,500.00	-135,998.79	-0.0309%

注： 1、 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	36,000,294.00	-
合计	36,000,294.00	-
项目	上年度末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	57,090,445.64	-
合计	57,090,445.64	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	101.79	15.07
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	-	18.04
应收债券利息	884,444.93	1,940,967.12
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	75,181.68	101,710.11
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	959,728.40	2,042,710.34

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	80.00
银行间市场应付交易费用	19,120.86	21,415.49
合计	19,120.86	21,495.49

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	359,000.00	359,000.00
合计	359,000.00	359,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国开货币 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	186,858,927.62	186,858,927.62
本期申购	367,258,564.21	367,258,564.21
本期赎回(以“-”号填列)	-454,115,893.02	-454,115,893.02
- 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	100,001,598.81	100,001,598.81

金额单位：人民币元

国开货币 B		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	252,795,739.40	252,795,739.40
本期申购	436,283,672.20	436,283,672.20
本期赎回(以“-”号填列)	-599,759,697.07	-599,759,697.07
- 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	89,319,714.53	89,319,714.53

注：申购含红利再投及分级份额调增份额；赎回含份额调减份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国开货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	4,866,422.66	-	4,866,422.66
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-4,866,422.66	-	-4,866,422.66
本期末	-	-	-

单位：人民币元

国开货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	6,561,948.82	-	6,561,948.82
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	-6,561,948.82	-	-6,561,948.82
本期末	-	-	-

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	3,126.41	2,227.27
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	19.23	45.86
其他	-	-
合计	3,145.64	468,939.78

注：于 2018 年度，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况（2017 年度：同）。

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	712,121.91	402,714.20
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	712,121.91	402,714.20

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,447,315,384.66	2,211,685,340.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,438,641,705.46	2,198,436,759.10
减：应收利息总额	7,961,557.29	12,845,867.25
买卖债券差价收入	712,121.91	402,714.20

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

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12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	290,000.00	290,000.00
其他费用	1,200.00	1,660.00
银行汇划费用	43,825.01	56,158.41

银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	431,025.01	443,818.41

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国开泰富基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,053,153.98	1,538,324.70
其中：支付销售机构的客户维护费	294,487.57	542,329.50

注：支付基金管理人国开泰富基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	319,137.58	466,158.95

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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	13,624.90	13,796.19	27,421.09
中国农业银行股份有限公司	112,742.15	3,395.99	116,138.14
国开证券股份有限公司	318.40	355.56	673.96
合计	126,685.45	17,547.74	144,233.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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
国开证券股份有限公司	419.49	13.70	433.19
合计	235,466.37	20,517.06	255,983.43

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国开泰富基金管理有限责任公司，再由国开泰富基金管理有限责任公司计算并

支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	33,990,259.35
期间申购/买入总份额	-	1,314,155.52
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	35,304,414.87
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	18.6500%

项目	上年度可比期间 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	-	7.7300%
-----------------------	---	---------

注：期间申购/买入总份额含红利再投。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

国开货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	3,184,845.09	1.6822%	3,052,503.13	0.6943%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 股份有限公司	115,258.63	3,126.41	48,552.55	2,227.27

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

国开货币A

已按再投资形式转实收基 金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
4,902,653.68	-	-36,231.02	4,866,422.66	-

国开货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
6,626,771.28	-	-64,822.46	6,561,948.82	-

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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 26,399,760.40 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
071800042	18 财通证券 CP003	2019 年 1 月 2 日	100.00	100,000	10,000,048.89
071800044	18 东北证券 CP006	2019 年 1 月 2 日	100.00	100,000	10,000,070.34
011800986	18 陕煤化 SCP008	2019 年 1 月 2 日	100.31	66,000	6,620,569.76
合计				266,000	26,620,688.99

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的高流动性、低风险品种。本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括现金、通知存款、短期融资券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。

本基金管理人建立了由风险控制委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度，而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在公司可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行 农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	20,000,119.23	-
A-1 以下	-	-

未评级	10,031,166.30	55,001,902.88
合计	30,031,285.53	55,001,902.88

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	129,096,857.61	288,082,126.41
合计	129,096,857.61	288,082,126.41

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、政策性金融债及央行票据以外的按长期信用评级的债券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。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，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2018 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 26,399,760.40 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，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 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与

债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	115,258.63	-	-	-	-	115,258.63
结算备付金	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	179,126,109.42	-	-	-	-	179,126,109.42
买入返售金融资产	36,000,294.00	-	-	-	-	36,000,294.00
应收利息	-	-	-	-	959,728.40	959,728.40

应收申购款					62,200.00	62,200.00
资产总计	215,241,662.05				-1,021,928.40	216,263,590.45
负债						
卖出回购金融资产款	26,399,760.40					26,399,760.40
应付管理人报酬					52,505.68	52,505.68
应付托管费					15,910.78	15,910.78
应付销售服务费					22,837.34	22,837.34
应付交易费用					19,120.86	19,120.86
应付利息					14,657.44	14,657.44
应交税费					1,835.12	1,835.12
应付利润					56,649.49	56,649.49
其他负债					359,000.00	359,000.00
负债总计	26,399,760.40				542,516.71	26,942,277.11
利率敏感度缺口	188,841,901.65				479,411.69	189,321,313.34
上年度末 2017 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	48,552.55					48,552.55
结算备付金	36,363.64					36,363.64
交易性金融资产	392,995,498.79					392,995,498.79
买入返售金融资产	57,090,445.64					57,090,445.64
应收利息					2,042,710.34	2,042,710.34
应收申购款					776,810.00	776,810.00
其他资产						
资产总计	450,170,860.62				-2,819,520.34	452,990,380.96
负债						
卖出回购金融资产款	12,572,741.14					12,572,741.14
应付管理人报酬					121,720.16	121,720.16
应付托管费					36,884.88	36,884.88
应付销售服务费					47,781.52	47,781.52
应付交易费用					21,495.49	21,495.49
应付利息					18,387.78	18,387.78
应付利润					157,702.97	157,702.97
其他负债					359,000.00	359,000.00
负债总计	12,572,741.14				762,972.80	13,335,713.94
利率敏感度缺口	437,598,119.48				-2,056,547.54	439,654,667.02

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，在影子价格监控机制有效的前提下，若市场利率上升或下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会发生重大变动。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	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	179,269,000.00	94.69	392,859,500.00	89.36
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	179,269,000.00	94.69	392,859,500.00	89.36

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 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 179,126,109.42 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：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)。

(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 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(2017 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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	179,126,109.42	82.83
	其中：债券	179,126,109.42	82.83

	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	36,000,294.00	16.65
	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	115,258.63	0.05
4	其他各项资产	1,021,928.40	0.47
5	合计	216,263,590.45	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	6.36	
	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	26,399,760.40	13.94
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券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余额比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 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	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	81
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

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存续期没有超过 120 天的情况。

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	40.20	13.94

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	36.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	26.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	10.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	113.69	13.94

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存续期没有超过 240 天的情况。

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	19,997,966.28	10.56
	其中：政策性金融债	19,997,966.28	10.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,031,285.53	15.86
6	中期票据	-	-
7	同业存单	129,096,857.61	68.19
8	其他	-	-
9	合计	179,126,109.42	94.61
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

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	160402	16 农发 02	200,000	19,997,966.28	10.56
2	111808330	18 中信银行 CD330	200,000	19,844,952.38	10.48

3	011800986	18 陕煤化 SCP008	100,000	10,031,166.30	5.30
4	071800044	18 东北证券 CP006	100,000	10,000,070.34	5.28
5	071800042	18 财通证券 CP003	100,000	10,000,048.89	5.28
6	111814241	18 江苏银行 CD241	100,000	9,963,393.95	5.26
7	111888721	18 宁波银行 CD229	100,000	9,963,279.34	5.26
8	111815604	18 民生银行 CD604	100,000	9,951,978.87	5.26
9	111883391	18 徽商银行 CD115	100,000	9,950,693.57	5.26
10	111813043	18 浙商银行 CD043	100,000	9,949,924.49	5.26

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	8
报告期内偏离度的最高值	0.2869%
报告期内偏离度的最低值	-0.0301%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1097%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内负偏离度的绝对值未达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内正偏离度的绝对值未达到 0.5%的情况。

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 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。

8.9.2 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的情况的说明

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。

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	959,728.40
4	应收申购款	62,200.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,021,928.40

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	4,368	22,894.14	3,273,479.65	3.27%	96,728,119.16	96.73%
国开货币B	6	14,886,619.09	70,389,975.51	78.81%	18,929,739.02	21.19%
合计	4,374	43,283.34	73,663,455.16	38.91%	115,657,858.18	61.09%

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	基金类机构	35,304,414.87	18.65%
2	其他机构	20,000,000.00	10.56%
3	其他机构	15,000,000.00	7.92%
4	个人	7,500,000.00	3.96%
5	个人	5,781,999.97	3.05%
6	个人	5,624,729.51	2.97%

7	基金类机构	3,184,845.09	1.68%
8	个人	2,071,246.41	1.09%
9	个人	2,030,220.58	1.07%
10	个人	1,904,950.23	1.01%

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	2,035,939.77	2.0359%
	国开货币 B	-	-
	合计	2,035,939.77	1.0754%

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	大于 100
	国开货币 B	-
	合计	大于 100
本基金基金经理持有本开放式基金	国开货币 A	-
	国开货币 B	-
	合计	-

§ 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	186,858,927.62	252,795,739.40
本报告期间基金总申购份额	367,258,564.21	436,283,672.20
减：本报告期间基金总赎回份额	454,115,893.02	599,759,697.07
本报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	100,001,598.81	89,319,714.53

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

2018 年 11 月 15 日通过股东会 2018 年第六次（临时）会议决议，江志平离任公司董事。

2018 年 11 月 15 日通过股东会 2018 年第六次（临时）会议决议，张雍川担任公司董事。

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	-	-	20.00	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	-	-	2,000,000.00	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%。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国开泰富货币市场证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 1 月 18 日
2	关于旗下基金在上海华信证券有限责任公司开通转换业务及参加上海华信证券有限责任公司开展的转换费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 1 月 29 日
3	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 2 月 8 日
4	关于参与北京展恒基金销售股份有限公司申（认）购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 2 月 10 日
5	国开泰富货币市场证券投资基金更新招募说明书(摘要)(2018 年第 1 号)	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 2 月 28 日
6	国开泰富货币市场证券投资基金更新招募说明书(2018 年第 1 号)	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 2 月 28 日
7	关于国开泰富旗下基金新增加北京植信基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 3 月 15 日
8	国开泰富货币市场证券投资基金 2017 年年度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 3 月 27 日
9	国开泰富货币市场证券投资基金 2017 年年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 3 月 27 日
10	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 3 月 29 日
11	关于持续参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 3 月 29 日
12	关于国开泰富基金管理有限责任公司旗下证券投资基金修改基金合同有关条款的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 3 月 29 日
13	国开泰富货币市场证券投资基金托管协议	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 3 月 29 日
14	国开泰富货币市场证券投资基	中国证券报、证券时报、上	2018 年 3 月 29 日

	金基金合同	海证券报、公司网站	
15	国开泰富货币市场证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 4 月 21 日
16	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 4 月 23 日
17	国开泰富货币市场证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 6 月 6 日
18	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 6 月 8 日
19	关于国开泰富旗下基金新增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 6 月 12 日
20	关于国开泰富旗下基金新增加民生证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 6 月 12 日
21	国开泰富基金管理有限责任公司关于暂停网上交易的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 6 月 13 日
22	国开泰富货币市场证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 7 月 20 日
23	国开泰富货币市场证券投资基金 2018 年半年度报告及摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 8 月 25 日
24	国开泰富货币市场证券投资基金更新招募说明书及摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 8 月 29 日
25	关于国开泰富旗下基金新增加中国民生银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 9 月 14 日
26	关于暂停国开泰富货币市场证券投资基金大额申购、转换转入业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 9 月 26 日
27	国开泰富货币市场证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2018 年 10 月 25 日

§ 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

机构	1	20180101- 20180507	150,005,750.42	1,574,725.93	151,580,476.35	0.00	0.00%
	2	20181213- 20181218	33,990,259.35	1,314,155.52	0.00	35,304,414.87	18.65%
	3	20181225- 20181226	33,990,259.35	1,314,155.52	0.00	35,304,414.87	18.65%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据公司发展需要，国开泰富基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”）及子公司北京国开泰富资产管理有限公司办公地址于 2019 年 1 月 7 日由北京市东城区朝阳门北大街 7 号五矿广场 C 座 10 层，搬迁至北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地。

13.3 查阅方式

以上备查文件存放在基金管理人、基金托管人所在地，供公众查阅。

投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人国开泰富基金管理有限责任公司。

客户服务中心电话：010-59363299

网址：www.cdbsfund.com

国开泰富基金管理有限责任公司

2019 年 3 月 30 日