国开泰富货币市场证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8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	331,681,026.83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	151,059,854.15份	180,621,172.68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	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@cdbfund.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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cdbfund.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

基金级别	国开货币A	国开货币B
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	3,101,341.68	3,722,236.84
本期利润	3,101,341.68	3,722,236.84
本期净值收益率	1.9455%	2.0671%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	151,059,854.15	180,621,172.68
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

金额单位:人民币元

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

3.本基金基金合同生效日为2015年1月14日。

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

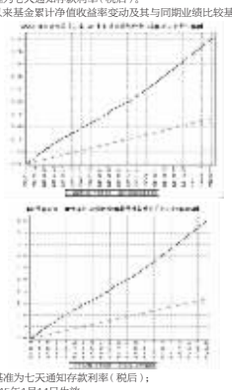
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2798%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.1688%	0.0024%
过去三个月	0.9630%	0.0089%	0.3366%	0.0000%	0.6264%	0.0089%
过去六个月	1.9455%	0.0065%	0.6935%	0.0000%	1.2760%	0.0065%
过去一年	3.9396%	0.0063%	1.3500%	0.0000%	2.5896%	0.0063%
过去三年	10.9656%	0.0107%	4.0537%	0.0000%	6.9119%	0.0107%
自基金合同生效起至今	12.8602%	0.0107%	4.6751%	0.0000%	8.1851%	0.0107%

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
过去一个月	0.2998%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.1888%	0.0024%
过去三个月	1.0234%	0.0089%	0.3366%	0.0000%	0.6868%	0.0089%
过去六个月	2.0671%	0.0065%	0.6935%	0.0000%	1.3976%	0.0065%
过去一年	4.1897%	0.0063%	1.3500%	0.0000%	2.8397%	0.0063%
过去三年	11.7673%	0.0107%	4.0537%	0.0000%	7.7136%	0.0107%
自基金合同生效起至今	13.8033%	0.0107%	4.6751%	0.0000%	9.1282%	0.0107%

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



注:1.本基金业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)。

2.本基金基金合同于2015年1月14日生效;

3.按基金合同规定,本基金建仓期为6个月。截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同第十二部分(二)投资范围、(四)投资限制的有关约定。

§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		
洪宴	固定收益投资总监,本基金基金经理	2015年1月14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(DPC)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11个月	中央财经大学经济法专业硕士,曾任越民基金管理有限公司越民货币市场基金、越民多利债券基金投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遵规守信情况的说明

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,报告期间未出现异常不到位的情况,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、跨月期间明显好于预期,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味行情。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,同购等业务,银监会发布《商业银行委托投资管理办法》、《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前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启起伏,李未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,机构配置红补抬升,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%。

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,二季度适当拉长久期,适当增配较长期限的高等级信用债及同业存单。同时着重提前应对缴解春节、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1.9455%,本报告期国开货币B的基金份额净值收益率为2.0671%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

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度加杠杆。

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专项债发行提前,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,在悲观预期一预期差修正中呈现窄幅回调-下行趋势,信用方面,前期受宏观环境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,我们倾向于相对利极的策略,以长久期、高等级挺时配置,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。

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 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,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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§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:国开泰富货币市场证券投资基金

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
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	1,859,636.15	48,552.55
结算备付金		-	36,363.64
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	328,814,497.27	392,995,498.79
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		328,814,497.27	392,995,498.79
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	28,800,283.20	57,090,445.64
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,331,376.22	2,042,710.34
应收股利		-	-
应收申购款		22,705.97	776,810.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		361,828,498.81	452,990,380.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		29,699,785.15	12,572,741.14
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		96,548.94	121,720.16
应付托管费		29,257.27	36,884.81
应付销售服务费		40,202.22	47,781.52
应付交易费用	6.4.7.7	22,191.81	21,495.49
应交税费		7,881.47	-
应付利息		5,660.12	18,387.78
应付利润		63,384.10	157,702.97
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	182,560.90	359,000.00
负债合计		30,147,471.98	13,335,713.94
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	331,681,026.83	439,654,667.02
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		331,681,026.83	439,654,667.02
负债和所有者权益总计		361,828,498.81	452,990,380.96

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额总额331,681,026.83份。其中国开货币A基金份额净值1.0000元,基金份额总额151,059,854.15份;国开货币B基金份额净值1.0000元,基金份额总额180,621,172.68份。

6.2 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年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		8,352,803.81	12,912,720.96
1.利息收入		8,096,743.57	12,662,074.15
其中:存款利息收入	6.4.7.11	1,763.07	468,096.86
债券利息收入		7,023,802.10	10,098,286.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,070,178.40	2,095,690.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		257,060.24	250,646.81
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	257,060.24	250,646.81
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
减:二.费用		1,629,225.29	2,550,173.45
1.管理人报酬	6.4.9.2.1	567,207.30	898,959.69
2.托管费	6.4.9.2.2	171,881.06	272,412.04
3.销售服务费	6.4.9.2.3	212,546.51	285,250.91
4.交易费用	6.4.7.19	-	100.00
5.利息支出		354,911.31	872,646.12
其中:卖出回购金融资产支出		354,911.31	872,646.12
6.税金及附加		5,925.80	-
7.其他费用	6.4.7.20	216,753.31	220,804.69
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		6,823,578.52	10,362,547.51
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		6,823,578.52	10,362,547.51

注:本基金基金合同生效日为2015年1月14日。

6.3 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)	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(本期净利润)	-	6,823,578.52	6,823,578.52
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)	-107,973,640.19	-	-107,973,640.19
其中:1.基金申购款	539,336,066.55	-	539,336,066.55
2.基金赎回款	-647,309,706.74	-	-647,309,706.74
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)	-	-6,823,578.52	-6,823,578.52
五、期末所有者权益(基金净值)	331,681,026.83	-	331,681,026.83
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	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(本期净利润)	-	10,362,547.51	10,362,547.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-404,994,325.94	-	-404,994,325.94
其中:1.基金申购款	985,159,744.20	-	985,159,744.20
2.基金赎回款	-1,390,154,070.14	-	-1,390,154,070.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-10,362,547.51	-10,362,547.51
五、期末所有者权益(基金净值)	263,051,718.95	-	263,051,718.95

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:

杨凌 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

6.4 报表附注

6.4.1 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号子公证验证。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8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《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《关于金融机构间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。

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	1,859,636.15
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:	1,859,636.15

注:定期存款的存款期限指票面存期。

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			
		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	328,814,497.27	329,180,000.00	365,502.73	0.1102%
	合计	328,814,497.27	329,180,000.00	365,502.73	0.1102%
资产支持券		-	-	-	-
合计		328,814,497.27	329,180,000.00	365,502.73	0.1102%

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。

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

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
买入返售证券_银行间	28,800,283.20	-
合计	28,800,283.20	-

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	165.03
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	2,288,859.73
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	42,351.46
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	2,331,376.22

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	100.00
银行间市场应付交易费用	22,091.81
合计	22,191.81

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	-
预提费用	182,560.90
合计	182,560.90

6.4.7.9 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6月30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	300,593,503.44	300,593,503.44
本期赎回(以“-”号填列)	-336,392,576.91	-336,392,576.91
-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	151,059,854.15	151,059,854.15

国开货币B		
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	252,795,739.40	252,795,739.40
本期申购	238,742,563.11	238,742,563.11
本期赎回(以“-”号填列)	-310,917,129.83	-310,917,129.83
-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	180,621,172.68	180,621,172.68

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	3,101,341.68	-	3,101,341.68
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中:基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,101,341.68	-	-3,101,341.68
本期末	-	-	-

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	3,722,236.84	-	3,722,236.84
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中:基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,722,236.84	-	-3,722,236.84
本期末	-	-	-

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	1,743.84
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	19.23
其他	-
合计	1,763.07

注:本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情