国开泰富货币市场证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月30日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于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。

§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	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	贺萌
	联系电话	010-59363088	010-66060069
	电子邮箱	yuebin@cdhsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-59363299	95599
传真		010-59363220	010-68121816

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

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	
期末基金资产净值	100,001,598.81	89,319,714.53	186,858,927.62	252,795,739.40	188,884,267.13	479,161,777.76
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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

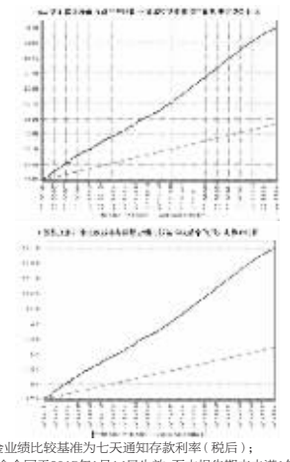
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6619%	0.0045%	0.3403%	0.0000%	0.3216%	0.0045%
过去六个月	1.4863%	0.0046%	0.6805%	0.0000%	0.8058%	0.0046%
过去一年	3.4607%	0.0057%	1.3500%	0.0000%	2.1107%	0.0057%
过去三年	10.6997%	0.0085%	4.0537%	0.0000%	6.6460%	0.0085%
自基金合同生效起至今	14.5377%	0.0102%	5.3556%	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%

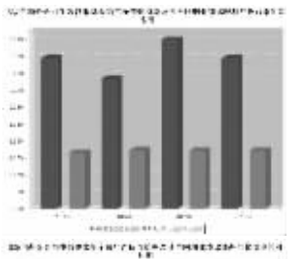
注:本基金业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)。

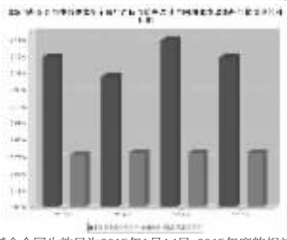
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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





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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

国开货币A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
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,受中美贸易战再度微化影响,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

注:本报告中财务资料经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	36,000,294.00	57,090,445.64
应收证券清算款	-	-
应收利息	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	-	-
资产总计	216,263,590.45	452,990,380.96
负债和所有者权益	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	-	-
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	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	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	189,321,313.34	439,654,667.02
未分配利润	-	-
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	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	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	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	712,121.91	402,714.20
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减:二、费用	2,775,017.59	4,560,957.41
1. 管理人报酬	1,053,153.98	1,538,324.70
2. 托管费	319,137.58	466,158.95
3. 销售服务费	370,949.94	596,879.52
4. 交易费用	-	-
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	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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 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