

# 国开泰富岁月鎏金定期开放信用债券型证 券投资基金 2014 年半年度报告

2014 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.11 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金	
基金简称	国开岁月鑒金定开信用债	
基金主代码	000412	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 12 月 23 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	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	355,685,981.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国开岁月鑒金定开信用债 A	国开岁月鑒金定开信用债 C
下属分级基金的交易代码:	000412	000413
报告期末下属分级基金的份额总额	327,282,204.86 份	28,403,776.37 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，在严格控制风险的前提下，结合大类资产配置策略、久期配置策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用类债券策略、息差策略、可转换债券投资策略等，通过对宏观经济指标、货币政策和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境的分析，动态调整各类固定收益类资产的配置比例，实现风险和收益的最佳配比。
业绩比较基准	6 个月定期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王兰兰
	联系电话	010-59363168
	电子邮箱	wanglanlan@cdbsfund.com
客户服务电话	010-59363299	95559
传真	010-59363220	021-58408483
注册地址	北京市怀柔区北房镇幸福	上海市银城中路 188 号

	西街 3 号 416 室	
办公地址	北京市东城区朝阳门北大街 7 号五矿广场 C 座 10 层	上海市银城中路 188 号
邮政编码	100010	200120
法定代表人	黎维彬	牛锡明

## 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、证券日报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国开泰富基金管理有限责任公司	北京市东城区朝阳门北大街 7 号五矿广场 C 座 10 层
审计基金财产的会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

## § 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	国开岁月鑒金定开信用债 A	国开岁月鑒金定开信用债 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	13,377,907.78	1,964,396.07
本期利润	15,661,743.52	2,246,313.61
加权平均基金份额本期利润	0.0376	0.0347
本期加权平均净值利润率	3.70%	3.43%
本期基金份额净值增长率	3.92%	3.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	3,823,787.04	279,991.88
期末可供分配基金份额利润	0.0117	0.0099
期末基金资产净值	333,359,330.27	28,879,081.13
期末基金份额净值	1.019	1.017
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	4.12%	3.92%

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 2013 年 12 月 23 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

国开岁月鑒金定开信用债 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	0.89%	0.08%	0.23%	0.01%	0.66%	0.07%
过去三个月	2.48%	0.06%	0.69%	0.01%	1.79%	0.05%
过去六个月	3.92%	0.06%	1.39%	0.01%	2.53%	0.05%
自基金合同生效起至今	4.12%	0.06%	1.46%	0.01%	2.66%	0.05%

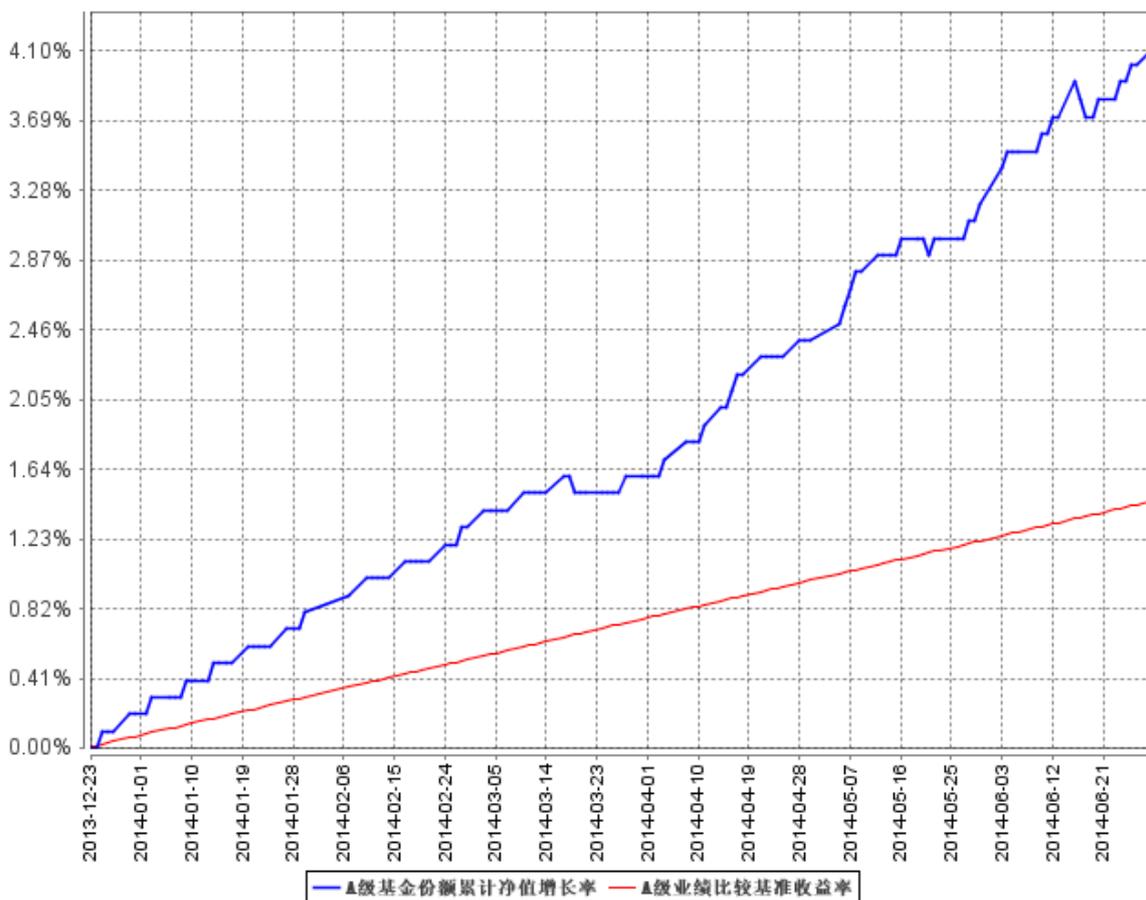
国开岁月鑒金定开信用债 C

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	0.89%	0.08%	0.23%	0.01%	0.66%	0.07%
过去三个月	2.39%	0.06%	0.69%	0.01%	1.70%	0.05%
过去六个月	3.72%	0.06%	1.39%	0.01%	2.33%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.92%	0.06%	1.46%	0.01%	2.46%	0.05%

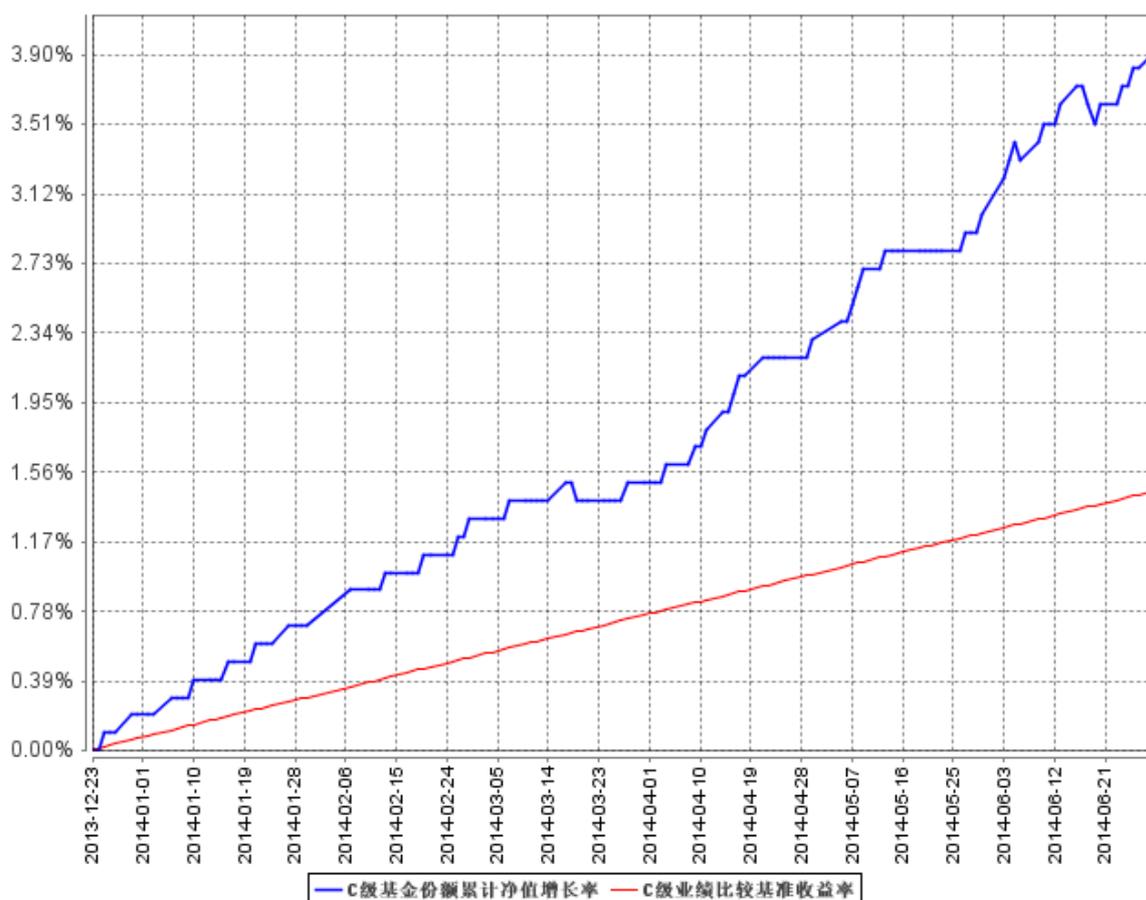
注：本基金业绩比较基准为 6 个月定期存款利率（税后）。

### 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、本基金基金合同于 2013 年 12 月 23 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：债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于信用债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；但应开放期流动性需要，在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，在封闭期内，本基金不受 5%的限制。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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，注册资本为人民币贰亿元整，其中国开证券有限责任公司出资比

例为 66.7%，国泰证券投资信托股份有限公司出资比例为 33.3%。公司经营范围包括：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2014 年 6 月 30 日，公司旗下管理 1 只开放式基金——国开泰富岁月臻金定期开放信用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		
洪宴	投资部总经理，本基金基金经理	2013 年 12 月 23 日	-	1 年	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。

注：1、任职日期说明：洪宴的任职日期为基金合同生效的日期。

2、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

#### 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

上半年，宏观经济下行压力偏大，定向微刺激政策频繁出台，政策重心倾向稳增长。央行通过公开市场回购、短期流动性调节工具(SLO)和常设借贷便利(SLF)、定向降准等工具，多措并举，积极主动地设定货币市场短期利率走廊，创造较为宽松的货币环境，加上同业非标监管的整顿与强化，债券市场收益率大幅下行。

本基金在运作时，在债券账户开立过程中，把握年终及春节效应，全部投资中短期高收益的银行协议存款。在债券账户开立后，及时根据利率走势及宏观研判，调整投资策略，组合久期由短及长，较好把握住了上半年债券牛市的行情：在保持一定比例与第一开放期限匹配的基础上，对信用债，采取“一级申购、二级获利减持”滚动交易及“买长卖短”的骑乘交易策略；对中长期政策性金融债积极进行波段交易，博取价差；保持较高比例的杠杆息差策略，增强收益。在 5 月下旬第一个开放期来临之际，提前减持短期债券回笼流动性，从容满足第一个开放期的流动性需求，之后在加强信用分析与甄选的基础上，重点以中低评级国企背景的信用债为重点配置品种，维持组合中等久期，适当增持交易所可转债，静观其变。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，国开岁月鑒金定开信用债 A 净值增长率 3.92%，国开岁月鑒金定开信用债 C 净值

增长率 3.72%，业绩比较基准收益率为 1.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，“稳增长”超越“调结构”，财政政策与货币政策定向发力，部分对冲了房地产领域的负面影响，加上外需复苏好于预期，令二季度 GDP 同比增长 7.5%，稍优于市场预期，上半年同比增长 7.4%，接近李克强总理 7.5% 的目标。6 月工业增加值 9.2%，较五月 8.7% 出现明显回升，经济企稳迹象日趋明显。基建投资维持高速增长，对冲房地产的态势延续，政府托底经济意愿较高。但我们也看到，目前的经济趋稳，更多地依然是依靠基建等传统领域的投资带动，市场对其可持续性疑虑较重，特别是传统的增长引擎房地产领域并未出现好转迹象，实体经济融资贵问题依然突出，经济下行风险并未解除。考虑到如何解决融资贵问题可能成为下半年政策的焦点之一，意味着基准利率难以大幅回升，基本面仍有利于债市。

短期看，经济低位企稳将弱化大规模刺激政策出台的可能，而 6 月末远超预期的 M2 增长数据，则进一步降低了货币总量放松政策的可能。尽管三季度预计央行仍将维持较为宽松的流动性，但在“宽货币”向“宽信贷”、“金融底”向“经济底”转变过程中，债市利空因素略大于利多因素，债市区间、横盘振荡的可能性较大，其中，10 年国开债波动区间 5.0~5.40%，而中低评级信用债券在负面事件冲击下，继续演绎分化行情，信用利差高位振荡。

央行在二季度货币政策报告中对总量宽松政策的偏谨慎态度，部分对冲了公开市场操作利率下调的利好效应，而短期股市的亮丽表现也令债市承受一定的资金分流压力，故本基金认为票息而非资本利得将成为债券近期的主要收益来源，在权衡风险与收益的基础上，加强信用分析与甄选，以中低评级国企背景的信用债为重点配置品种，维持组合中等久期策略，控制杠杆率，适当获利减持部分债券进行置换操作，并波段参与大盘可转债交易，增强组合收益。

#### 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 4 人，分别是公司基金运营部负责人、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 2014 年 5 月 19 日发布分红公告，A 类按每 10 份基金份额派发红利 0.220 元；C 类按每 10 份基金份额派发红利 0.220 元，本次分红总金额为 11,361,316.17 元，权益登记日为 2014 年 5 月 21 日。

本基金本报告期内共计派发红利 257,170,419.24 元，报告期内已无应分配但未分配利润。

## § 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

2014 年上半年度，基金托管人在国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2014 年上半年度，国开泰富基金管理有限责任公司在国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 11,361,316.17 元，符合基金合同的规定。

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

2014 年上半年度，由国开泰富基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情

况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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：国开泰富岁月鑫金定期开放信用债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	59,413.10	516,432,995.05
结算备付金		6,830,000.00	-
存出保证金		96.47	-
交易性金融资产	6.4.7.2	457,070,600.00	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		457,070,600.00	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	5,530,624.26	1,064,584.88
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		469,490,733.83	517,497,579.93
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 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		106,699,319.95	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		171,325.99	67,978.23
应付托管费		57,108.67	22,659.41
应付销售服务费		9,674.96	6,430.26
应付交易费用	6.4.7.7	31,002.17	-

应交税费		-	-
应付利息		43,807.99	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	240,082.70	-
负债合计		107,252,322.43	97,067.90
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	355,685,981.23	516,423,468.58
未分配利润	6.4.7.10	6,552,430.17	977,043.45
所有者权益合计		362,238,411.40	517,400,512.03
负债和所有者权益总计		469,490,733.83	517,497,579.93

注：1. 报告截止日 2014 年 6 月 30 日，国开岁月鑒金定开信用债 A 基金份额净值 1.019 元，基金份额总额 327,282,204.86 份；国开岁月鑒金定开信用债 C 基金份额净值 1.017 元，基金份额总额 28,403,776.37 份；国开岁月鑒金定开信用债份额总额 355,685,981.23 份。

2. 本基金基金合同生效日为 2013 年 12 月 23 日。

## 6.2 利润表

会计主体：国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		21,435,322.98
1.利息收入		18,715,825.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,403,833.71
债券利息收入		11,998,350.25
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		313,641.80
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		133,728.90
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	133,728.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
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	2,565,753.28
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	20,015.04
<b>减：二、费用</b>		3,527,265.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,455,566.66

2. 托管费	6.4.10.2.2	485,188.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	130,610.51
4. 交易费用	6.4.7.19	22,637.15
5. 利息支出		1,181,343.21
其中：卖出回购金融资产支出		1,181,343.21
6. 其他费用	6.4.7.20	251,919.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>17,908,057.13</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>17,908,057.13</b>

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 12 月 23 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国开泰富岁月鑫金定期开放信用债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	516,423,468.58	977,043.45	517,400,512.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,908,057.13	17,908,057.13
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）	-160,737,487.35	-971,354.24	-161,708,841.59
其中：1.基金申购款	94,165,199.53	1,113,772.72	95,278,972.25
2.基金赎回款	-254,902,686.88	-2,085,126.96	-256,987,813.84
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）	-	-11,361,316.17	-11,361,316.17
五、期末所有者权益（基金净值）	355,685,981.23	6,552,430.17	362,238,411.40

注：本基金基金合同生效日为 2013 年 12 月 23 日。

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>王翀</u>	<u>张智</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

国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2013]1347 号文件《关于核准国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金募集的批复》的批准，由国开泰富基金管理有限责任公司向社会公开募集，基金合同于 2013 年 12 月 23 日生效。首次募集规模为 516,324,489.64 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金 A 类基金份额的最高申购费率不超过 5%，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。本基金 C 类基金份额不收取申购费。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国开泰富基金管理有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的企业债券、公司债券、国债、央行票据、地方政府债、商业银行金融债与次级债、中小企业私募债券、政策性金融债、中期票据、资产支持证券、可转换债券（含可分离交易可转债）、短期融资券、债券回购和银行存款等固定收益类资产，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）。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于信用债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前一个月至开放期结束后一个月内不受前述比例限制。开放期内，基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：6 个月定期存款利率（税后）。

### 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 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债券投资和资产支持证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或资产支持证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

本基金持有的债券投资和资产支持证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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 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。当本基金依法有权抵销债权债务且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。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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，其公允价值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和托管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也可按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息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，不需要进行分部报告的披露。

#### **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) 对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》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债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### **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、中国证监会财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关

于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	59,413.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	59,413.10

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	6,244,243.70	6,476,600.00	232,356.30

	银行间市场	448,260,603.02	450,594,000.00	2,333,396.98
	合计	454,504,846.72	457,070,600.00	2,565,753.28
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	454,504,846.72	457,070,600.00	2,565,753.28

#### 6.4.7.2.1 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。

#### 6.4.7.3 买入返售金融资产

##### 6.4.7.3.1 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。

##### 6.4.7.3.2 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。

#### 6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	1,562.74
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	1,291.68
应收债券利息	5,527,769.84
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	-
合计	5,530,624.26

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,235.00
银行间市场应付交易费用	25,767.17
合计	31,002.17

## 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提账户维护费-上清所	4,500.00
预提账户维护费-中债登	4,500.00
预提信息披露费用	198,354.28
预提审计费用	32,728.42
合计	240,082.70

## 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

国开岁月鑒金定开信用债 A		
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	443,145,955.62	443,145,955.62
本期申购	91,682,540.46	91,682,540.46
本期赎回(以“-”号填列)	-207,546,291.22	-207,546,291.22
- 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	327,282,204.86	327,282,204.86

金额单位：人民币元

国开岁月鑒金定开信用债 C		
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,277,512.96	73,277,512.96
本期申购	2,482,659.07	2,482,659.07
本期赎回(以“-”号填列)	-47,356,395.66	-47,356,395.66
- 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	28,403,776.37	28,403,776.37

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。

**6.4.7.9 未分配利润**

单位：人民币元

国开岁月鑒金定开信用债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	843,928.51	-	843,928.51
本期利润	13,377,907.78	2,283,835.74	15,661,743.52
本期基金份额交易产生的变动数	-648,838.19	-30,497.37	-679,335.56
其中：基金申购款	712,600.17	374,267.17	1,086,867.34
基金赎回款	-1,361,438.36	-404,764.54	-1,766,202.90
本期已分配利润	-9,749,211.06	-	-9,749,211.06
本期末	3,823,787.04	2,253,338.37	6,077,125.41

单位：人民币元

国开岁月鑒金定开信用债 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	133,114.94	-	133,114.94
本期利润	1,964,396.07	281,917.54	2,246,313.61
本期基金份额交易产生的变动数	-205,414.02	-86,604.66	-292,018.68
其中：基金申购款	15,292.53	11,612.85	26,905.38
基金赎回款	-220,706.55	-98,217.51	-318,924.06
本期已分配利润	-1,612,105.11	-	-1,612,105.11
本期末	279,991.88	195,312.88	475,304.76

**6.4.7.10 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	79,437.62
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,321,128.09
结算备付金利息收入	3,267.66
其他	0.34
合计	6,403,833.71

注：“其他”为结算保证金利息收入。

**6.4.7.11 股票投资收益**

本基金本报告期末投资股票。

**6.4.7.12 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,114,014,902.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,094,043,671.26
减：应收利息总额	19,837,502.04
债券投资收益	133,728.90

#### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未投资贵金属。

##### 6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖收益权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	2,565,753.28
——股票投资	-
——债券投资	2,565,753.28
——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	-
合计	2,565,753.28

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	15.04
手续费返还	20,000.00
合计	20,015.04

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	12.15
银行间市场交易费用	22,625.00
合计	22,637.15

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	32,728.42
信息披露费	198,354.28
银行间账户维护费	13,500.00
银行费用	6,436.73
开户费	900.00
合计	251,919.43

#### 6.4.7.20 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1

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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国开证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构
国泰证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京国开泰富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 本报告期本基金关联方未发生变化。

2. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期没有通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,455,566.66
其中：支付销售机构的客户维护费	437,034.18

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	485,188.89

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.2.3 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 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国开岁月鑒金定开信用债 A	国开岁月鑒金定开信用债 C	合计
交通银行股份有限公司	-	103,275.51	103,275.51
国开证券有限责任公司	-	18,617.76	18,617.76
合计	-	121,893.27	121,893.27

注：基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未投资本基金。

### 6.4.10.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	59,413.10	2,267,576.79

注：其中当期利息收入 79,437.62 元为交通银行股份有限公司保管的活期存款产生的当期利息收入，其余部分当期利息收入是由定期存款产生。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
交通银行股份有限公司	041453021	14 徐矿 CP001	新债发行	100,000	10,000,000.00
交通银行股份有限公司	041457001	14 中色 CP001	新债发行	100,000	10,000,000.00
交通银行股 份有限公司	041469006	14 重汽 CP001	新债发行	100,000	10,000,000.00

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

国开岁月鑒金定开信用债 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2014 年 5 月 20 日	2014 年 5 月 21 日	2014 年 5 月 21 日	0.2200	9,749,211.06	-	9,749,211.06	
合计	-	-	-	0.2200	9,749,211.06	-	9,749,211.06	

国开岁月鑒金定开信用债 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2014 年 5 月 20 日	2014 年 5 月 21 日	2014 年 5 月 21 日	0.2200	1,612,105.11	-	1,612,105.11	
合计	-	-	-	0.2200	1,612,105.11	-	1,612,105.11	

**6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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隐认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 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 106,699,319.95 元，是以如下债券作为质押：

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
1182190	11 石药 MTN1	2014 年 7 月 2 日	99.13	200,000	19,826,000.00
130422	13 农发 22	2014 年 7 月 2 日	99.65	300,000	29,895,000.00
1382253	13 山钢 MTN2	2014 年 7 月 2 日	93.72	200,000	18,744,000.00
140423	14 农发 23	2014 年 7 月 2 日	103.69	200,000	20,738,000.00
101454009	14 船重 MTN001	2014 年 7 月 4 日	100.77	200,000	20,154,000.00
合计				1,100,000	109,357,000.00

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

### 6.4.13.2 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债券发行人信用评级降低导致债券价格下降以及发行人出现违约、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。

本基金管理人建立了内部评级体系和债券库、交易对手库管理制度，对发行人及所投资债券进行内部评级，设定风险限额，对交易对手的资信状况进行充分评估，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 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 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
A-1	40,186,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	40,186,000.00	-

注：以上按短期信用评级及长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。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
AAA	45,374,600.00	-
AAA 以下	320,877,000.00	-
未评级	-	-
合计	366,251,600.00	-

注：以上按短期信用评级及长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。

### 6.4.13.3 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。

本基金为定期开放基金，封闭期内不接受基金赎回申请，而在每个开放期前，本基金管理人将会估算与模拟本基金的流动性需求，变现基金所持有的部分证券，满足基金的赎回要求。本基金所投资的证券集中在证券交易所或银行间市场交易，均能以合理价格适时变现。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险指因受各种因素影响而引起的证券及其衍生品市场价格不利波动，使投资组合资产、

公司资产面临损失的风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的所投资证券市场价格或现金流量等，所受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年 6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	59,413.10	-	-	-	-	-	59,413.10
结算备付金	6,830,000.00	-	-	-	-	-	6,830,000.00
存出保证金	96.47	-	-	-	-	-	96.47
交易性金融资产	-	-	70,078,000.00	331,018,600.00	55,974,000.00	-	457,070,600.00
应收利	-	-	-	-	-	5,530,624.26	5,530,624.26

息							
资产总计	6,889,509.57	-	70,078,000.00	331,018,600.00	55,974,000.00	5,530,624.26	469,490,733.83
负债							
卖出回购金融资产款	106,699,319.95	-	-	-	-	-	106,699,319.95
应付管理人报酬		-	-	-	-	171,325.99	171,325.99
应付托管费		-	-	-	-	57,108.67	57,108.67
应付销售服务费		-	-	-	-	9,674.96	9,674.96
应付交易费用		-	-	-	-	31,002.17	31,002.17
应付利息		-	-	-	-	43,807.99	43,807.99

息							
其他 负债	-	-	-	-	-	240,082.70	240,082.70
负债 总计	106,699,319.95	-	-	-	-	553,002.48	107,252,322.43
利率 敏感 度缺 口	-99,809,810.38	-	70,078,000.00	331,018,600.00	55,974,000.00	4,977,621.78	362,238,411.40
上年 度末 2013 年12 月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行 存款	116,432,995.05	400,000,000.00	-	-	-	-	516,432,995.05
应收 利息	-	-	-	-	-	1,064,584.88	1,064,584.88
资产 总计	116,432,995.05	400,000,000.00	-	-	-	1,064,584.88	517,497,579.93
负债							
应付 管	-	-	-	-	-	67,978.23	67,978.23

理人报酬							
应付托管费						22,659.41	22,659.41
应付销售服务费						6,430.26	6,430.26
负债总计						97,067.90	97,067.90
利率敏感度缺口	116,432,995.05	400,000,000.00				967,516.98	517,400,512.03

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、除市场利率以外的其他市场变量保持不变。		
	3、此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	利率下降25个基点	3,216,238.94	-
	利率上升25个基点	-3,180,228.58	-

注：2013年12月31日，基金主要投资于协议定期存款，视为持有至到期投资。

#### 6.4.13.4.2 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，无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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、信用风险、外汇汇率等以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，主要风险为利率风险和信用风险，其他的风险因素对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	457,070,600.00	97.35
	其中：债券	457,070,600.00	97.35
	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	6,889,413.10	1.47
7	其他各项资产	5,530,720.73	1.18
8	合计	469,490,733.83	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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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

本基金本报告期无买入股票明细。

#### 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

本基金本报告期无卖出股票明细。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期无买入卖出股票交易。

### 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	50,633,000.00	13.98
	其中：政策性金融债	50,633,000.00	13.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,186,000.00	11.09
6	中期票据	359,775,000.00	99.32
7	可转债	6,476,600.00	1.79
8	其他	-	-
9	合计	457,070,600.00	126.18

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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	101456037	14 玉柴 MTN001	300,000	29,994,000.00	8.28
2	101469010	14 丰台国资 MTN001	300,000	29,934,000.00	8.26
3	130422	13 农发 22	300,000	29,895,000.00	8.25
4	1382217	13 天业 MTN1	300,000	29,586,000.00	8.17
5	101356012	13 酒钢 MTN001	200,000	20,912,000.00	5.77

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**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资产支持证券。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 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。

**7.10.3 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。

**7.11 投资组合报告附注**

7.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.11.3 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	96.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,530,624.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,530,720.73

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113005	平安转债	5,341,000.00	1.47
2	113003	重工转债	1,135,600.00	0.31

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.6 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
国开岁月鑒金定开信用债 A	485	674,808.67	281,078,274.53	85.88%	46,203,930.33	14.12%
国开岁月鑒金定开信用债 C	360	78,899.38	7,150,357.00	25.17%	21,253,419.37	74.83%
合计	845	420,980.16	288,228,631.53	81.03%	67,457,349.70	18.97%

### 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	国开岁月鑒金定开信用债 A	2,579,961.02	0.7900%
	国开岁月	300,240.00	1.0600%

	鑒金定开信用债 C		
	合计	2,880,201.02	0.8100%

### 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

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	国开岁月鑒金定开信用债 A	-
	国开岁月鑒金定开信用债 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国开岁月鑒金定开信用债 A	10~50
	国开岁月鑒金定开信用债 C	-
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国开岁月鑒金定开信用债 A	国开岁月鑒金定开信用债 C
基金合同生效日（2013 年 12 月 23 日）基金份额总额	443,145,955.62	73,277,512.96
本报告期期初基金份额总额	443,145,955.62	73,277,512.96
本报告期基金总申购份额	91,682,540.46	2,482,659.07
减：本报告期基金总赎回份额	207,546,291.22	47,356,395.66
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	327,282,204.86	28,403,776.37

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金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

1、基金管理人：

2014 年 6 月 28 日，基金管理人发布公告，自 2014 年 6 月 28 日起，王翀先生代任基金管理人董事长，原董事长黎维彬先生离任。

2、基金托管人托管部门：

报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

无。

**10.4 基金投资策略的改变**

无。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金本报告期没有改聘会计师事务所。

**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**

本基金管理人及其相关高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

**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	
国泰君安	2	-	-	3,550.00	67.81%	-
安信证券	2	-	-	175.00	3.34%	-
信达证券	2	-	-	700.00	13.37%	-
申银万国	2	-	-	810.00	15.47%	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重投资研究服务质量

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c) 券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 确定券商范围：券商的选择由公司分管投资的经理层人员及投资部、专户投资部、交易部、研究部、监察稽核部负责人组成的办公会议集体讨论拟合作券商名单。

b) 初始评分确定合作名单：由研究部、投资部、专户投资部、交易部对拟合作券商进行评分，根据评分结果确定合作券商，报公司总经理办公会审批。

c) 交易量分配：投资部、研究部、专户投资部、交易部根据券商提供的研究报告质量和综合研究服务的情况，于每季前三个工作日分别对券商进行评分。交易部将评分结果进行汇总，形成最终评分结果，作为当季分配交易量的依据。公司严禁将席位开设与券商的基金销售挂钩，严禁以任何形式向券商承诺基金在席位上的交易量。

d) 日常监控：公司监察稽核部、交易部、风险管理部、基金运营部、研究部等相关部门均可从各自业务角度对合作券商进行监控，当合作券商发生可能导致基金持有人利益受损的事件时，各部门均可提请暂停与该券商经纪业务的合作，经公司监察稽核部、交易部、风险管理部、基金运营部、研究部会商后执行。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 投资部、研究部、专户投资部、交易部根据证券公司提供的研究报告质量和综合研究服务的情况，于每季前三个工作日分别对证券公司进行评分。交易部将投资部、研究部、专户投资部、交易部对证券公司的评分结果进行汇总，形成最终评分结果，作为当季分配交易量的依据。交易部于每季初根据最新评分结果，与累计席位交易量进行比较，拟定席位使用调整计划，填写《券商交易席位分配表》。经公司领导审批后执行。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

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
国泰君安	-	-	355,000,000.00	67.88%	-	-
安信证券	1,238,130.00	19.31%	17,000,000.00	3.25%	-	-
信达证券	5,173,300.00	80.69%	70,000,000.00	13.38%	-	-
申银万国	-	-	81,000,000.00	15.49%	-	-

10.8 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	国开泰富基金管理有限责任公司关于开展基金直销柜台费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2013年11月16日
2	国开泰富基金管理有限责任公司关于	中国证券报、证券时报、	2013年12月10

	开通基金直销网上交易及农行卡客户费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、 公司网站	日
3	国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2013年12月24 日
4	国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金 2013 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 1 月 1 日
5	关于国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 1 月 20 日
6	国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 4 月 21 日
7	国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金第一次分红公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 5 月 19 日
8	关于国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 5 月 21 日
9	国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金开放期办理申购、赎回业务公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 5 月 21 日
10	国开泰富基金管理有限责任公司关于开展基金直销柜台申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 5 月 21 日
11	国开泰富基金管理有限责任公司关于基金直销网上交易开通交通银行借记卡、工商银行借记卡支付并实施费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 5 月 26 日
12	关于国开泰富岁月鑒金定期开放信用债券型证券投资基金新增销售机构的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 6 月 3 日
13	国开泰富基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2014 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国开泰富岁月臻金定期开放信用债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国开泰富岁月臻金定期开放信用债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国开泰富岁月臻金定期开放信用债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集注册国开泰富岁月臻金定期开放信用债券型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。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

### 12.3 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](http://www.cdbsfund.com)

国开泰富基金管理有限责任公司  
2014年8月29日