

国泰现金管理货币市场基金 2013 年半年度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年八月二十四日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 20 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 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
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	11
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说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 债券回购融资情况	38
7.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明	38
7.4 基金投资组合平均剩余期限	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	40
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	40
7.9 投资组合报告附注	40
8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	41
9 开放式基金份额变动	42
10 重大事件揭示	42

10.1	基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4	基金投资策略的改变.....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	44
10.9	其他重大事件.....	44
11	备查文件目录.....	44
11.1	备查文件目录.....	44
11.2	存放地点.....	45
11.3	查阅方式.....	45

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰现金管理货币市场基金	
基金简称	国泰现金管理货币	
交易代码	020031	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年12月11日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	181,979,154.73份	
下属分级基金的基金简称	国泰现金管理货币A	国泰现金管理货币B
下属分级基金的交易代码	020031	020032
报告期末下属分级基金的份额总额	31,596,835.67份	150,382,319.06份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	<p>1. 整体配置策略</p> <p>基于对国家宏观政策（财政政策、货币政策等）和短期资金供求状况的深入研究，合理预期短期利率变化趋势，动态确定投资组合的平均剩余期限。</p> <p>2. 类别资产配置策略</p> <p>基于对各类别资产的流动性特征分析（日均成交量、交易方式、市场流量）、收益率水平（到期收益率、利息支付方式、利息税务处理、类别资产收益差异等）和风险特征（信用等级、波动性）的分析，确定投资组合的类别资产配置比例。</p> <p>3. 明细资产配置策略</p> <p>基于对明细资产的流动性、剩余期限和信用等级的分析，根据明细资产的收益率与剩余期限的配比、以及流动性指标等优化配置各明细资产。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：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低风险品

	种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、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		国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海中	唐州徽
	联系电话	021-38561600 转	95566
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		(021) 38569000, 400-888-8688	95566
传真		021-38561800	010-66594942
注册地址		上海市世纪大道 100 号 上海环球金融中心 39 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市世纪大道 100 号 上海环球金融中心 39 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		陈勇胜	田国立

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》
登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司登记注册中心	上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日)	
	国泰现金管理货币 A	国泰现金管理货币 B
本期已实现收益	2,254,811.13	6,786,000.30
本期利润	2,254,811.13	6,786,000.30
本期净值收益率	1.5711%	1.6940%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)	
	国泰现金管理货币 A	国泰现金管理货币 B
期末基金资产净值	31,596,835.67	150,382,319.06
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)	
	国泰现金管理货币 A	国泰现金管理货币 B
累计净值收益率	1.7511%	1.8880%

注：1、本基金利润分配按月结转份额。

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（不含公允价值变动收益）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，由于货币市场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。

3.2 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

1. 国泰现金管理货币 A:

阶段	份额净值收益率①	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	0.2858%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.1748%	0.0024%
过去三个月	0.7877%	0.0029%	0.3366%	0.0000%	0.4511%	0.0029%
过去六个月	1.5711%	0.0024%	0.6695%	0.0000%	0.9016%	0.0024%
自基金成立起至今	1.7511%	0.0023%	0.7469%	0.0000%	1.0042%	0.0023%

2. 国泰现金管理货币 B:

阶段	份额净值收益率①	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	0.3056%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.1946%	0.0024%

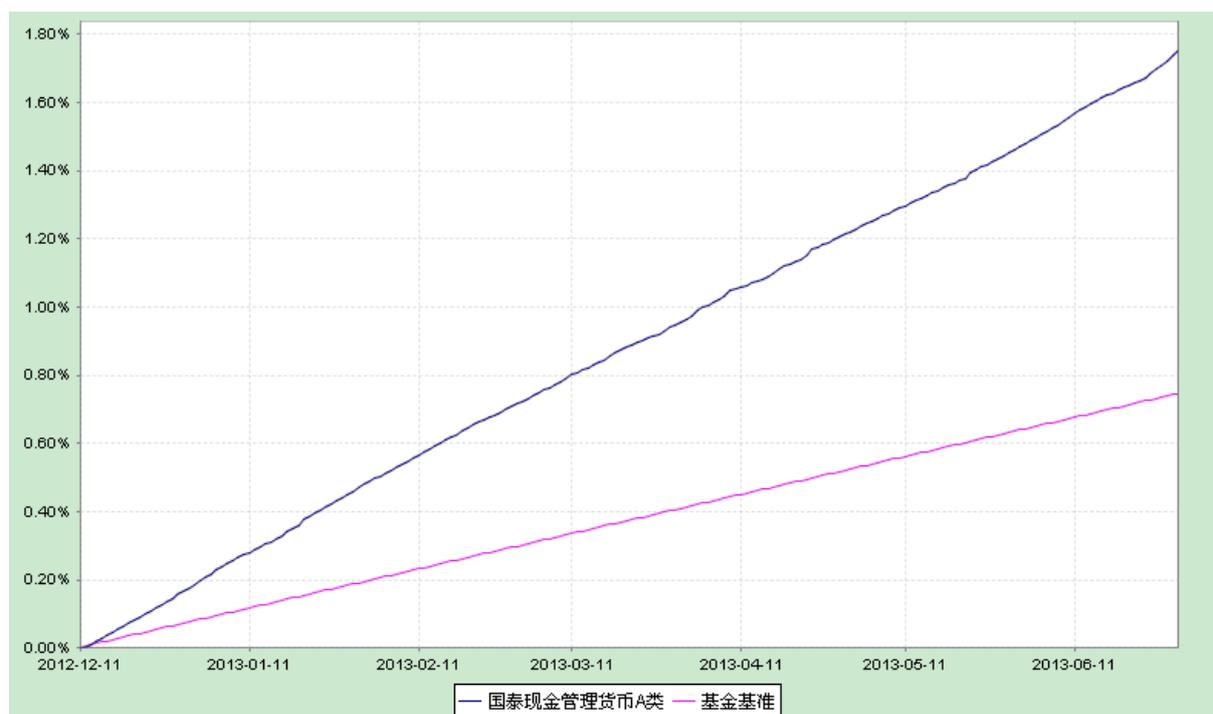
月						
过去三个月	0.8483%	0.0029%	0.3366%	0.0000%	0.5117%	0.0029%
过去六个月	1.6940%	0.0024%	0.6695%	0.0000%	1.0245%	0.0024%
自基金成立起至今	1.8880%	0.0023%	0.7469%	0.0000%	1.1411%	0.0023%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

国泰现金管理货币市场基金

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012 年 12 月 11 日至 2013 年 6 月 30 日)

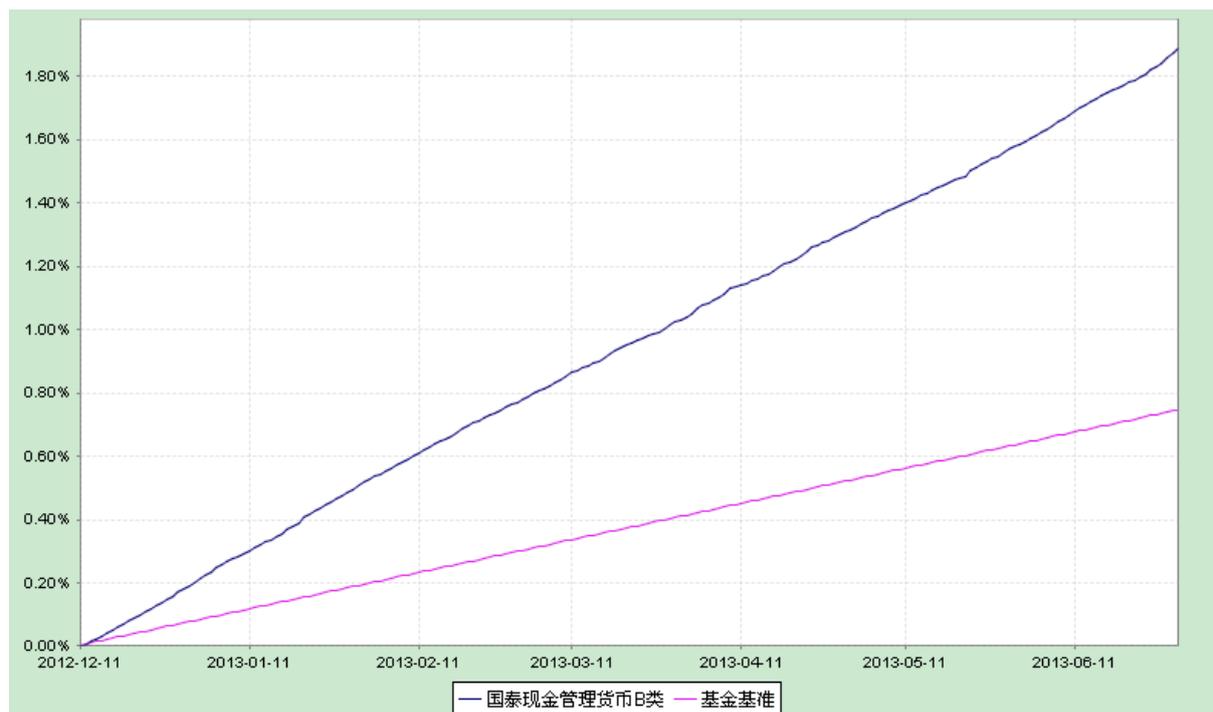
1、国泰现金管理货币 A



注：1、本基金的合同生效日为 2012 年 12 月 11 日，截止 2013 年 6 月 30 日，本基金运作时间不满一年。

2、本基金在一个月的建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2、国泰现金管理货币 B



注：1、本基金的合同生效日为 2012 年 12 月 11 日，截止 2013 年 6 月 30 日，本基金运作时间不满一年。

2、本基金在一个月的建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：金鑫证券投资基金，以及 35 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、

国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜南林	本基金的基金经理、国泰货币市场、国泰 6 个月短期理财债券的基金经理	2012-12-11	-	5	硕士研究生，2008 年 6 月至 2009 年 6 月在天相投资顾问有限公司担任宏观经济和债券分析师，2009 年 6 月至 2012 年 8 月在农银人寿保险股份有限公司（原嘉禾人寿保险股份有限公司）工作，先后担任宏观及债券研究员、固定收益投资经理，2012 年 8 月加入国泰基金管理有限公司，2012 年 12 月起任国泰现

					金管理货币市场基金及国泰货币市场证券投资基金的基金经理，2013 年 3 月起兼任国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、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。

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，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95% 置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向

交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 20 ），溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年上半年，在经济结构转型的大背景下，经济增长弱势复苏，通胀一波两折，通胀预期整体回落，基本面环境相对有利于债券市场。

但是，进入二季度下半段，资金面的波动对债券市场的冲击较大。由于海外资金通过虚假贸易等方式进行套利，今年 1-4 月份，月度新增外汇占款均在 2300 亿元以上，在此期间，市场资金面整体相对宽松，央行在今年 2 月 19 日重启暂停 8 个月的正回购，开始通过公开市场操作调节流动性；进入 5 月份，贷款增长仍然较快，广义货币供应量余额（M2）在 4 月份的增速达到 16.1%，显著超过 2013 年政府工作报告中提出的目标值（13%），央行于 5 月 9 日重启暂停 16 个月的央票发行，暗示货币政策立场从稳健偏松转变为稳健偏紧，再加上企业所得税集中清缴、外汇市场变化（5 月份新增外汇占款迅速回落至 668.6 亿元）、补缴法定准备金、端午节假期现金需求等多种因素的叠加影响，从 5 月下旬开始资金价格开始持续走高，至 6 月中下旬资金面出现前所未有的紧张，其中隔夜回购利率单笔最高达到 30%，7 天质押式回购利率单笔最高达到 28%，6 月份债券市场也出现了较大幅度的调整。

在此过程中，央行于 2 月 19 日重启正回购调节流动性，诱发债券市场在 3 月份的小调整，后因 3 月 25 日银监会 8 号文的发布，触发市场预期银行理财产品将增加债券资产的需求，债券收益率出现回调并创下上半年新低。

总而言之，2013 年上半年，基本面因素对债券市场走势的影响相对弱化，流动性层面的未预期因素左右了债券市场的走势，尤其是对货币市场的影响更大。

对于主要投资货币市场工具的货币基金来讲，2013 年上半年经历了两次较大的赎回冲击：第一次是起于 4 月 16 日的监管风暴，部分债券市场从业人员通过非法养券赚取灰色利益被监管部门查处，触发部分机构投资人的风控底线，引致其大规模、清空式的赎回货币基金，直到 4 月 24 日央行召开内部整顿会议才使冲击告一段落；第二次是端午节后由于资金面的持续紧张，资金价格高企，基金持有人开始全面赎回货币市场基金去银行间和交易所市场放逆回购，引致货币市场基金的系统性流动性危机。

本基金散户投资人相对分散且稳定，机构持有人相对集中且有大致的赎回时间安排，按照资产匹配的策略构建组合，并根据资金面的波动灵活调整，顺利应对 4 月份和 6 月份的货币市场流动性危机的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2013 年上半年的国泰现金管理货币 A 净值增长率为 1.5711%，国泰现金管理货币 B 净值增长率为 1.6940%，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

海外方面，美国经济复苏好于预期，美联储或择机逐步退出量化宽松货币政策，美元回流的趋势还将延续。国内方面，新一届政府更加关注经济增长质量和民生问题，围绕新型城镇化加快经济结构调整，下半年出台刺激政策的可能性不大，预计经济增长保持窄幅震荡；美元回流对美元指数的支撑有利于压制大宗商品价格，输入型通胀压力不大。2013 年下半年基本面因素仍然有利于债券市场。

货币政策方面，由于今年 1-5 月份广义货币供应量余额（M2）同比增速均超过 2013 年的调控目标值，隐含的潜在通胀压力不可轻视，另外为防范同业业务期限错配风险，我们预计今年下半年央行将保持稳健偏紧的货币政策立场，旨在通过维持相对偏紧的资金面迫使商业银行调整同业业务期限结构，保持社会融资总量的稳定增长，以达到“用好增量、盘活存量”的目的。在此过程中，如果月度新增外汇占款持续低于 1000 亿元甚至负增长，或者 M2 增速回落至 13% 以下，不排除央行下调法定存款准备金率和公开市场操作回收流动性相结合的方式管理流动性；如果遇未预期因素的冲击，央行将通过逆回购、短期流动性调节工具等管理流动性，再次出现 6 月中下旬资金面异常紧张的概率降低。

投资操作方面，本基金组合久期短，对流动性要求高，仍以配置协议存款为主，并且到期日的安排尽量与机构持有人的赎回安排匹配，或者选在月末、节假日前、季末、年末等时点；同时在不影响流动性的前提下优选中高等级短期融资券，增强组合调整的灵活性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人报告期内基金利润分配情况的说明

本基金利润分配按月结转份额。本基金管理人已根据本基金基金合同和相关法律法规的规定对应分配利润进行了分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国泰现金管理货币基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

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：国泰现金管理货币市场基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	111,766,275.02	2,262,362,519.66
结算备付金		331,818.18	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	59,994,170.65	-
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资		59,994,170.65	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,400,134.10	-
应收证券清算款		-	3,912,314.30
应收利息	6.4.7.5	838,303.83	-
应收股利		-	-
应收申购款		130,219.33	40,022.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		182,460,921.11	2,266,314,856.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,868.04	1,001.28
应付管理人报酬		79,877.57	547,457.94
应付托管费		24,205.29	165,896.28
应付销售服务费		10,293.41	208,436.72
应付交易费用	6.4.7.7	10,089.91	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		253,622.40	3,930,009.27
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	101,809.76	9,974.20
负债合计		481,766.38	4,862,775.69
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	181,979,154.73	2,261,452,080.77
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		181,979,154.73	2,261,452,080.77
负债和所有者权益总计		182,460,921.11	2,266,314,856.46

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.000元/份，基金份额总额181,979,154.73份，其中A类基金份额总额31,596,835.67份；B类基金份额总额150,382,319.06份。

6.2 利润表

会计主体：国泰现金管理货币市场基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		10,580,789.69	-
1.利息收入		10,222,546.78	-
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	7,485,343.32	-
债券利息收入		1,791,687.51	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		945,515.95	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		358,242.91	-
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	358,242.91	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-	-
减：二、费用		1,539,978.26	-
1. 管理人报酬		894,054.57	-

2. 托管费		270,925.60	-
3. 销售服务费		191,963.85	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	-	-
5. 利息支出		54,285.72	-
其中：卖出回购金融资产支出		54,285.72	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	128,748.52	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,040,811.43	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,040,811.43	-

注：本基金成立日为2012年12月11日，因此无上年度可比期间金额。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰现金管理货币市场基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	2,261,452,080.77	-	2,261,452,080.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,040,811.43	9,040,811.43
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）	-2,079,472,926.04	-	-2,079,472,926.04
其中：1.基金申购款	1,290,992,745.40	-	1,290,992,745.40
2.基金赎回款	-3,370,465,671.44	-	-3,370,465,671.44
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	-	-9,040,811.43	-9,040,811.43

少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	181,979,154.73	-	181,979,154.73
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减 少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	-	-	-

注：本基金成立日为2012年12月11日，因此无上年度可比期间金额。

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：

基金管理人负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：巴立康

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰现金管理货币市场基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会证监许可[2012]1324 号文核准。由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《国泰现金管理货币市场基金基金合同》、《国泰现金管理货币市场基金招募说明书》负责公开募集。

本基金为契约型、开放式证券投资基金。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用，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七日年化收益率。本基金的基金管理人和注册登记机构为国泰基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。本基金将自 2012 年 12 月 3 日至 2012 年 12 月 7 日通过基金管理人指定的销售机构公开发售。自 2012 年 12 月 11 日起，《国泰现金管理货币市场基金基金合同》正式生效。基金合同生效日的基金份额总额为 3,279,775,350.15 份基金份额，其中认购资金利息折合 180,468.69 元份基金份额。本基金根据基金份额持有人持有本基金的份额数量进行基金份额类别划分。本基金业绩比较基准：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泰基金管理有限公司于 2013 年 8 月 20 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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》、《国泰现金管理货币市场基金基金合同》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 2013 年半年度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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日止期间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

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，于交易日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。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即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，以避免债券投资的摊余成本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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本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债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

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，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的事件的，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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。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。

6.4.4.8 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后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本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。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不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，每日计算当日收益并全部结转至应付利润科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。基金投资当期亏损时，采用等比例调减基金份额持有人持有份额的方式，将基金份额净值维持在份额面值 1.00 元。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

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：

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》及其他相关税务法规和实务操作，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。2013 年 1 月 1 日以前，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，对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。

(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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	1,766,275.02
定期存款	110,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	110,000,000.00
其他存款	-
合计	111,766,275.02

注：1. 本年度本基金发生定期存款提前支取的情况，适用利率不变。

2. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 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	59,994,170.65	59,926,000.00	-68,170.65	-0.0375
	合计	59,994,170.65	59,926,000.00	-68,170.65	-0.0375

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

无余额。

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 2013年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间买入	9,400,134.10	-
合计	9,400,134.10	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	2,075.46
应收定期存款利息	117,961.40
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	134.37
应收债券利息	712,452.59
应收买入返售证券利息	5,673.39
应收申购款利息	6.62
其他	-

合计	838,303.83
----	------------

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	10,089.91
合计	10,089.91

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,569.05
预提费用	100,240.71
合计	101,809.76

6.4.7.9 实收基金

国泰现金管理货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	841,508,671.73	841,508,671.73
本期申购	74,236,023.91	74,236,023.91
本期赎回（以“-”号填列）	-884,147,859.97	-884,147,859.97
本期末	31,596,835.67	31,596,835.67

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

国泰现金管理货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,419,943,409.04	1,419,943,409.04
本期申购	1,216,756,721.49	1,216,756,721.49
本期赎回（以“-”号填列）	-2,486,317,811.47	-2,486,317,811.47
本期末	150,382,319.06	150,382,319.06

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

国泰现金管理货币 A

单位：人民币元

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	2,254,811.13	-	2,254,811.13
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	-2,254,811.13	-	-2,254,811.13
本期末	-	-	-

国泰现金管理货币 B

单位：人民币元

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	6,786,000.30	-	6,786,000.30
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	-6,786,000.30	-	-6,786,000.30
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	123,975.16
定期存款利息收入	7,338,813.72
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,176.84
其他	10,377.60
合计	7,485,343.32

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	629,311,510.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	620,217,646.49
减：应收利息总额	8,735,621.16
债券投资收益	358,242.91

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

无。

6.4.7.15 股利收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

无。

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 交易费用

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	47,954.14
信息披露费	42,312.37
银行汇划费用	31,582.01
开户费	900.00
债券账户服务费	6,000.00
合计	128,748.52

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日后的收益分配事项如下：

2013 年度	宣告日	分配收益所属期间
第 7 号收益支付公告	2013-06-26	2013-06-03 至 2013-07-01

6.4.9 关联方关系

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

本基金管理人于 2013 年 5 月 31 日发布《国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告》，本基金管理人获批设立子公司国泰元鑫资产管理有限公司，注册资本为 5000 万元人民币。本基金管理人持有 50% 的股权，中投信托有限责任公司和上海津赞投资管理有限公司分别持有 30% 和 20% 的股权。国泰元鑫资产管理有限公司已在上海市工商行政管理局虹口分局完成工商注册登记，取得营业执照。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国建银投资有限责任公司（“中国建投”）	基金管理人的控股股东

中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2013年1月1日至2013年 6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	894,054.57	-
其中：支付销售机构的客户维护费	174,938.42	-

注：1、支付基金管理人国泰基金管理有限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。

2、本基金成立日为2012年12月11日，因此无上年度可比期间金额。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年 6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	270,925.60	-

注：1、支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%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 0.1% / 当年天数。

2、本基金成立日为2012年12月11日，因此无上年度可比期间金额。

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 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰现金管理货币 A	国泰现金管理货币 B	合计
国泰基金管理有限公司	1,883.21	15,670.76	17,553.97
中国银行	159,687.16	4,433.75	164,120.91
合计	161,570.37	20,104.51	181,674.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰现金管理货币 A	国泰现金管理货币 B	合计
国泰基金管理有限公司	-	-	-
中国银行	-	-	-
合计	-	-	-

注：1、支付A类基金份额基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，对于由B类降级为A类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

支付B类基金份额基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.01%的年费率计提，对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到B类条件的开放日后的下一个工作日起享受B类基金份额持有人的费率，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.01% / 当年天数。

2、本基金成立日为2012年12月11日，因此无上年度可比期间金额。

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
无。

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

无。

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

国泰现金管理货币 A

无。

国泰现金管理货币 B

无。

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	61,766,275.02	247,206.28	-	-

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率利息。

2、本基金成立日为2012年12月11日，因此无上年度可比期间金额。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

1、国泰现金管理货币 A

单位：人民币元

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
2,601,061.78	1,029,721.03	-1,375,971.68	2,254,811.13	-

2、国泰现金管理货币B

单位：人民币元

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
6,638,391.15	2,448,024.34	-2,300,415.19	6,786,000.30	-

6.4.12 期末（2013 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

本基金投资的金融工具主要为各类货币市场工具。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现在保证本金安全和资产流动性最大化的前提下，追求超过业绩比较基准的收益的投资目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

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。本基金的银行存款一部分存放在本基金的托管行中国农业银行，一部分存放在中国银行股份有限公司以及中信银行股份有限公司，与该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，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。

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 2013 年 6 月 30 日	上年末 2012 年 12 月 31 日
A-1	39,995,225.30	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	39,995,225.30	-

注：本基金持有的未评级的债券均为国债、中央银行票据或政策性金融债。

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 2013 年 6 月 30 日	上年末 2012 年 12 月 31 日
AAA	19,998,945.35	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	19,998,945.35	-

注：本基金持有的未评级的债券均为国债、中央银行票据或政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于一家公司发行的短期企业债券的比例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短期企业债券不得超过该短期企业债券的 10%。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 180 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。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，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。

本基金所持有的全部金融负债的合约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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 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	111,766,275.02		-	-	-	111,766,275.02
结算备付金	331,818.18		-	-	-	331,818.18
交易性金融资产	59,994,170.65		-	-	-	59,994,170.65
买入返售金融资 产	9,400,134.10		-	-	-	9,400,134.10
应收利息	-		-	-	838,303.83	838,303.83
应收申购款	90,000.00		-	-	40,219.33	130,219.33
资产总计	181,582,397.95		-	-	878,523.16	182,460,921.11
负债						
应付赎回款	-		-	-	1,868.04	1,868.04
应付管理人报酬	-		-	-	79,877.57	79,877.57
应付托管费	-		-	-	24,205.29	24,205.29
应付销售服务费	-		-	-	10,293.41	10,293.41
应付交易费用	-		-	-	10,089.91	10,089.91
应付利润	-		-	-	253,622.40	253,622.40
其他负债	-		-	-	101,809.76	101,809.76
负债总计	-		-	-	481,766.38	481,766.38
利率敏感度缺口	181,582,397.95		-	-	396,756.78	181,979,154.73
上年度末 2012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	2,262,362,519.66		-	-	-	2,262,362,519.66
应收利息	-		-	-	3,912,314.30	3,912,314.30
应收申购款	-		-	-	40,022.50	40,022.50
资产总计	2,262,362,519.66		-	-	3,952,336.80	2,266,314,856.46

负债						
应付赎回款	-		-	-	1,001.28	1,001.28
应付管理人报酬	-		-	-	547,457.94	547,457.94
应付托管费	-		-	-	165,896.28	165,896.28
应付销售服务费	-		-	-	208,436.72	208,436.72
应付利润	-		-	-	3,930,009.27	3,930,009.27
其他负债	-		-	-	9,974.20	9,974.20
负债总计	-		-	-	4,862,775.69	4,862,775.69
利率敏感度缺口	2,262,362,519.66		-	-	-910,438.89	2,261,452,080.77

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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	除市场利率外其他市场变量不变		
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）	
		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	市场利率下降25个基点	增加约1	-
	市场利率上升25个基点	减少约1	-

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，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于2013年6月30日，本基金未持有交易性权益投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 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) 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。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 59,994,170.65 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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级未发生重大变动。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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。

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	固定收益投资	59,994,170.65	32.88
	其中：债券	59,994,170.65	32.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	9,400,134.10	5.15
	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	112,098,093.20	61.44
4	其他各项资产	968,523.16	0.53
5	合计	182,460,921.11	100.00

7.2 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	0.56	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购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净值比例的简单平均值。

7.3 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.4 基金投资组合平均剩余期限

7.4.1 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	23
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	12

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

7.4.2 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	77.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	10.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	10.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天 (含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	99.73	-

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	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	19,998,945.35	10.99

	其中：政策性金融债	19,998,945.35	10.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	39,995,225.30	21.98
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	59,994,170.65	32.97
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	120228	12 国开 28	200,000	19,998,945.35	10.99
2	071301004	13 招商 CP004	200,000	19,998,320.21	10.99
3	071310004	13 光大证券 CP004	200,000	19,996,905.09	10.99

7.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0471%
报告期内偏离度的最低值	-0.0856%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0225%

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.000 元。

7.9.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率

债券的摊余成本未超过基金资产净值的 20%。

7.9.3 本报告期内，基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

7.9.4 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	838,303.83
4	应收申购款	130,219.33
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	968,523.16

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
国泰现金管理货币A	772	40,928.54	555,367.89	1.76%	31,041,467.78	98.24%
国泰现金管理货币B	1	150,382,319.06	150,382,319.06	100.00%	-	-
合计	773	235,419.35	150,937,686.95	82.94%	31,041,467.78	17.06%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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	国泰现金管理货币 A	38,052.48	0.12%
	国泰现金管理货币 B	-	-
	合计	38,052.48	0.02%

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰现金管理货币 A	国泰现金管理货币 B
基金合同生效日（2012 年 12 月 11 日）基金份额总额	1,639,372,934.91	1,640,402,415.24
本报告期期初基金份额总额	841,508,671.73	1,419,943,409.04
本报告期基金总申购份额	74,236,023.91	1,216,756,721.49
减：本报告期基金总赎回份额	884,147,859.97	2,486,317,811.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,596,835.67	150,382,319.06

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

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

报告期内基金管理人重大人事变动如下：

2013 年 3 月 6 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》刊登了《国泰基金管理有限公司副总经理离任公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十四次会议审议通过，同意梁之平先生因工作需要离职。

2013 年 6 月 25 日，本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第五届董事会第二十七次会议审议通过，同意李志坚先生出任公司副总经理。

报告期内基金托管人重大人事变动如下：

2013 年 3 月 17 日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于 2013 年 3 月 17 日公告上述事项。

2013 年 6 月 1 日，中国银行股份有限公司发布公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国

立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。

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

报告期内，基金管理人、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

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	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	-	-	1,965,000,000.00	100.00%	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

10.9 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	国泰现金管理货币市场基金2013年春节假期前暂停申购、转换转入业务公告	《中国证券报》	2013-02-01
2	国泰现金管理货币市场基金2013年“清明”假期前暂停申购、转换转入业务公告	《中国证券报》	2013-03-27
3	国泰现金管理货币市场基金2013年“五一”假期前暂停申购、转换转入业务公告	《中国证券报》	2013-04-20
4	国泰基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-04-26
5	国泰基金管理有限公司关于增开现金管理货币市场基金A类T+0快速取现服务的公告	《中国证券报》	2013-05-09
6	国泰基金管理有限公司关于设立国泰元鑫资产管理有限公司的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2013-05-31
7	国泰现金管理货币市场基金2013年“端午”假期前暂停申购、转换转入业务公告	《中国证券报》	2013-06-03

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、国泰现金管理货币市场基金基金合同
- 2、国泰现金管理货币市场基金托管协议
- 3、关于同意国泰现金管理货币市场基金募集的批复

- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

11.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼。

11.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 38569000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 38569000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司
二〇一三年八月二十四日