

国泰现金管理货币市场基金
2016 年年度报告摘要
2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月二十八日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2017 年 3 月 24 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》等法律法规的规定及《国泰现金管理货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，本基金管理人决定自 2016 年 6 月 17 日起按照《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》的要求修改《基金合同》，同时根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规对《基金合同》进行相应修改。基金管理人对《国泰现金管理货币市场基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）中涉及上述修改的内容进行相应修改。具体内容可查阅本基金管理人于 2016 年 6 月 17 日披露的《国泰基金管理有限公司关于修改国泰现金管理货币市场基金基金合同和托管协议的公告》。

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 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	国泰现金管理货币	
基金主代码	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	1,097,329,941.93 份	
基金合同存续期	不定期	
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	237,807,971.35 份	859,521,970.58 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	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	李永梅	王永民
	联系电话	021-31081600转	010-66594896
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95566
传真		021-31081800	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉显大厦 16 层-19 层及基金托管人住所

§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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年		2015 年		2014 年	
	国泰现金管理货币 A	国泰现金管理货币 B	国泰现金管理货币 A	国泰现金管理货币 B	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	5,359,816.81	19,706,220.33	9,560,951.57	28,896,931.03	17,841,916.67	136,341,518.14
本期利息	5,359,816.81	19,706,220.33	9,560,951.57	28,896,931.03	17,841,916.67	136,341,518.14

润	6.81	3			7	
本期净 值收益 率	2.2349%	2.4800%	3.6111%	3.8599%	4.3717%	4.6220%
3.1.2 期 末数据 和 指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	国泰现金 管理货币 A	国泰现金管理 货币 B	国泰现金管理 货币 A	国泰现金管理货 币 B	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	237,807, 971.35	859,521,970. 58	226,495,739. 11	1,836,608,421. 64	374,599,992. 91	1,346,864,401. 13
期末基 金份额 净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

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	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	0.4847%	0.0015%	0.3393%	0.0000%	0.1454%	0.0015%
过去六个月	1.0690%	0.0051%	0.6787%	0.0000%	0.3903%	0.0051%
过去一年	2.2349%	0.0039%	1.3500%	0.0000%	0.8849%	0.0039%
过去三年	10.5573%	0.0059%	4.0500%	0.0000%	6.5073%	0.0059%
自基金合同生效 起至今	14.8318%	0.0090%	5.4775%	0.0000%	9.3543%	0.0090%

2. 国泰现金管理货币 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	0.5009%	0.0023%	0.3393%	0.0000%	0.1616%	0.0023%
过去六个月	1.1908%	0.0051%	0.6787%	0.0000%	0.5121%	0.0051%
过去一年	2.4800%	0.0039%	1.3500%	0.0000%	1.1300%	0.0039%
过去三年	11.3549%	0.0059%	4.0500%	0.0000%	7.3049%	0.0059%
自基金合同生效 起至今	16.2356%	0.0056%	5.4775%	0.0000%	10.7581%	0.0056%

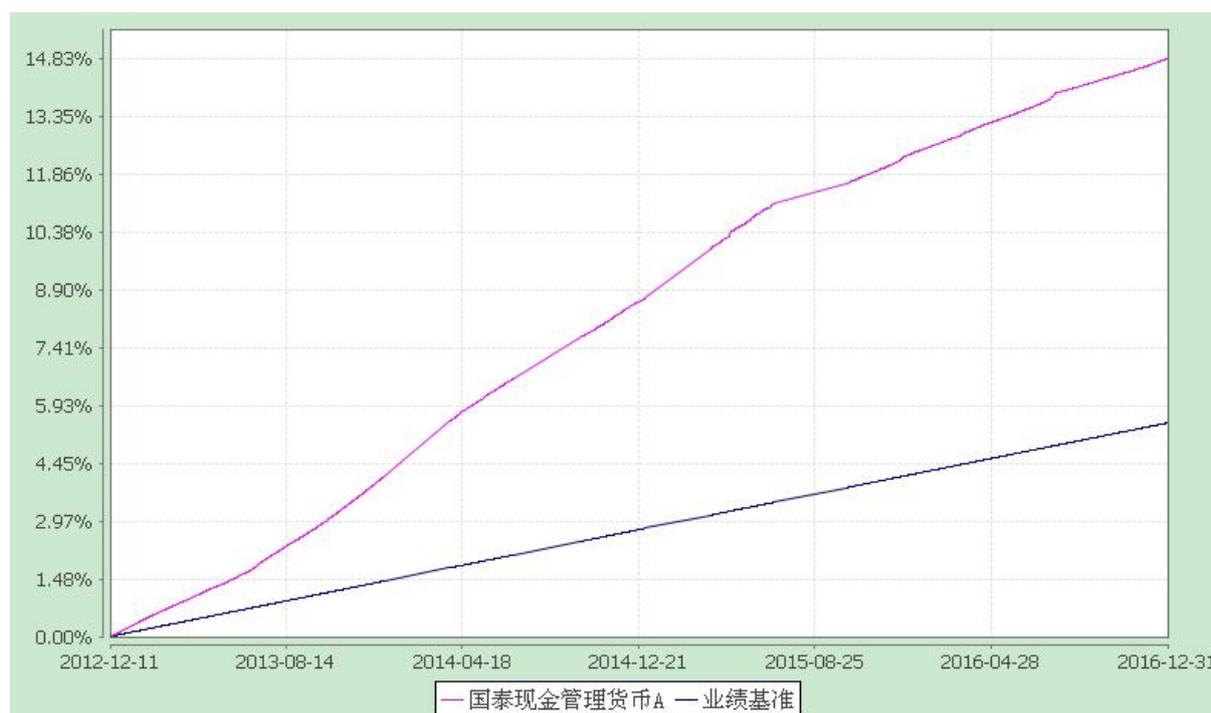
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

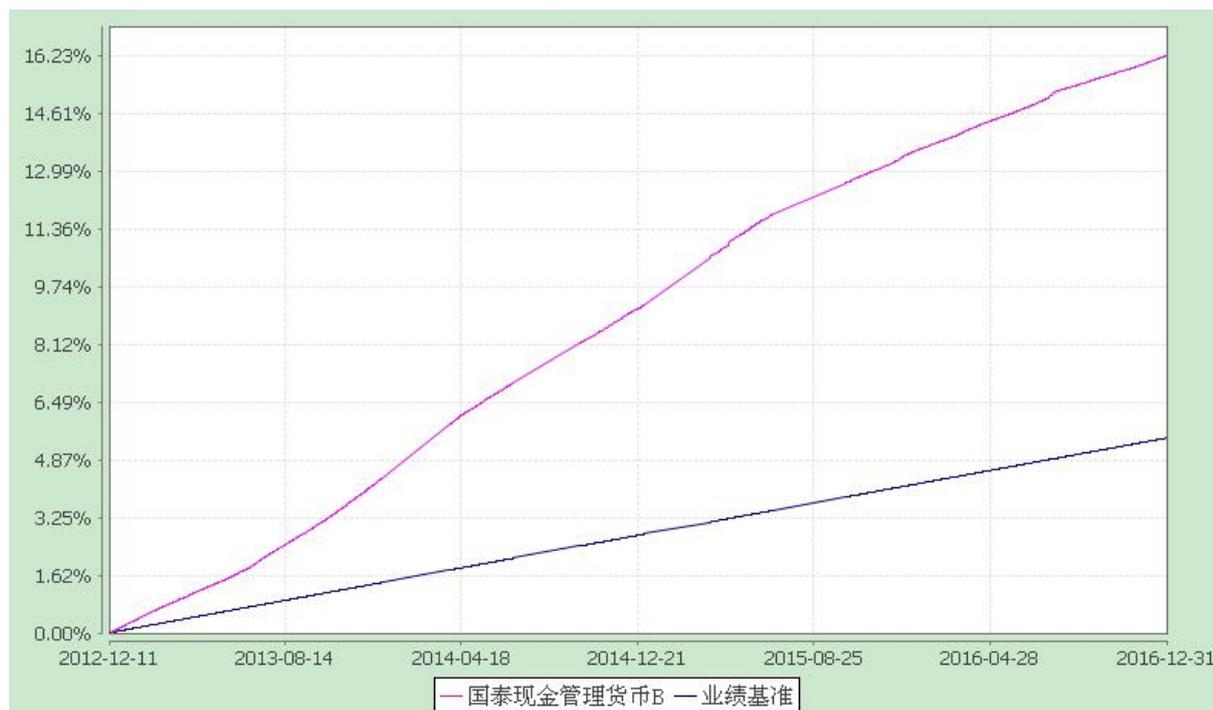
(2012 年 12 月 11 日至 2016 年 12 月 31 日)

1、国泰现金管理货币 A



注：本基金合同生效日为 2012 年 12 月 11 日，本基金在一个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2、国泰现金管理货币 B



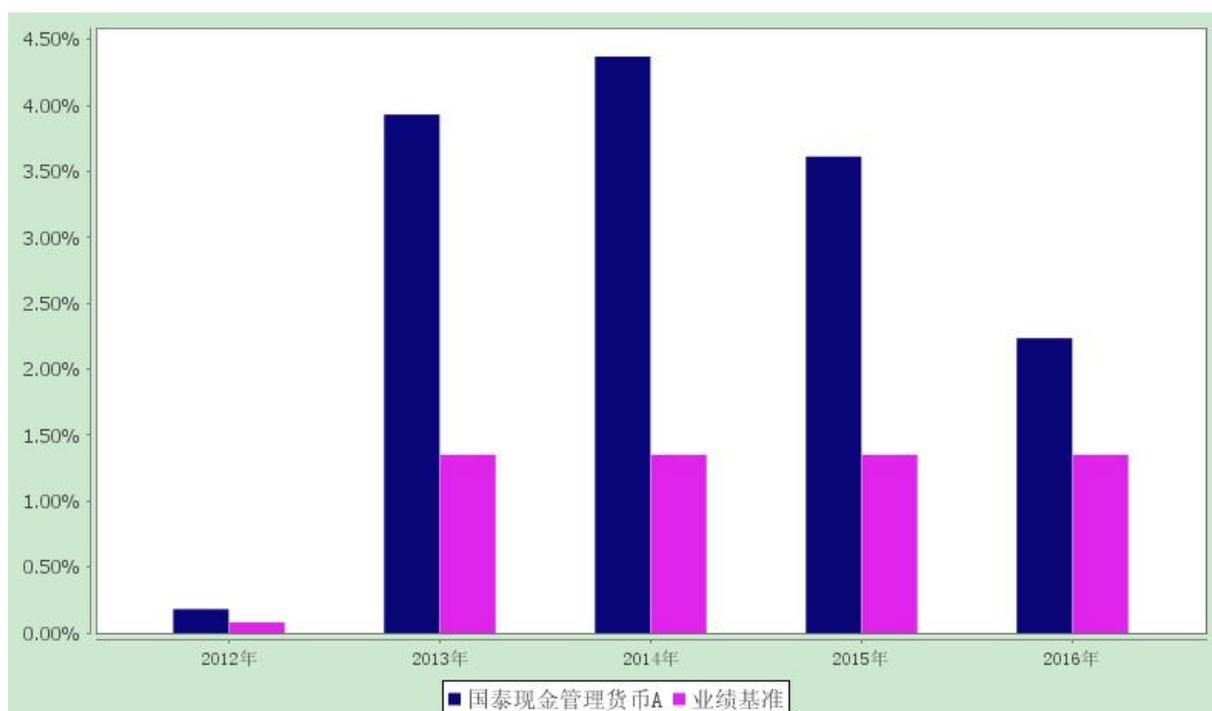
注：本基金合同生效日为 2012 年 12 月 11 日，本基金在一个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰现金管理货币市场基金

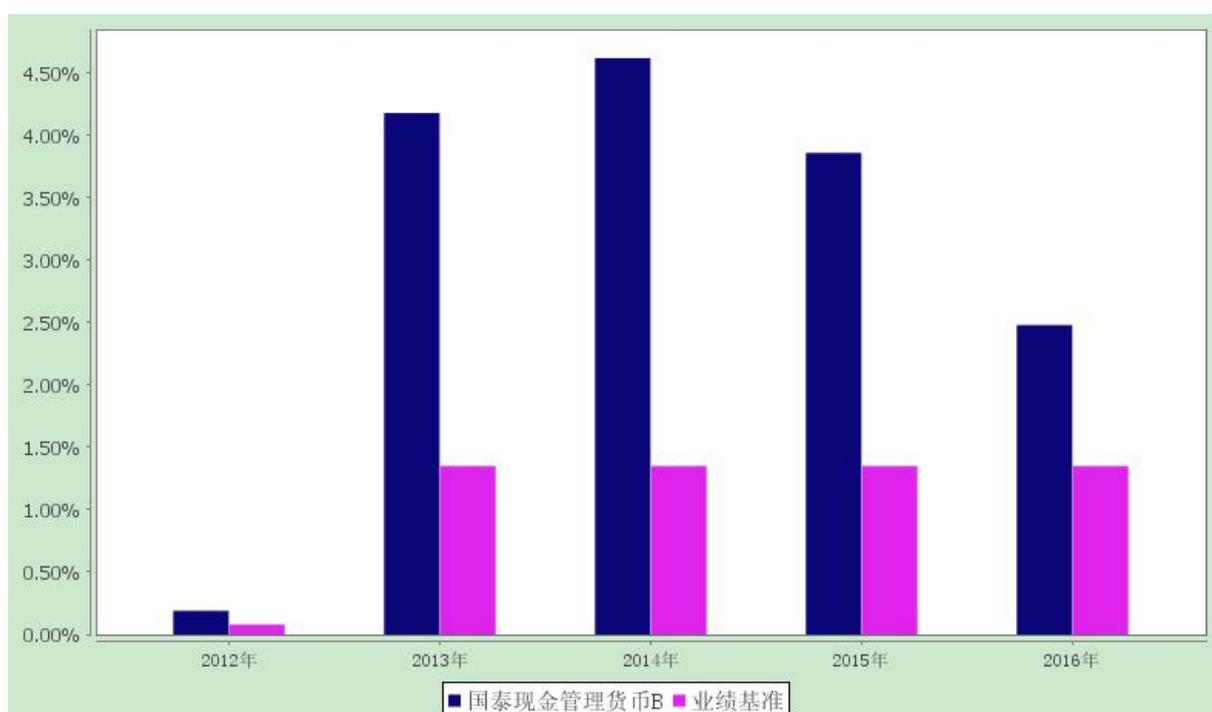
自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1、国泰现金管理货币 A



注：本基金合同于 2012 年 12 月 11 日生效，截止至 2012 年 12 月 31 日未满一年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2、国泰现金管理货币 B



注：本基金合同于 2012 年 12 月 11 日生效，截止至 2012 年 12 月 31 日未满一年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

国泰现金管理货币 A:

单位: 人民币元

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
2016	3,693,613.59	1,878,789.89	-212,586.67	5,359,816.81	-
2015	7,370,315.69	2,448,478.12	-257,842.24	9,560,951.57	-
2014	15,839,166.57	3,003,869.06	-1,001,118.96	17,841,916.67	-
合计	26,903,095.85	7,331,137.07	-1,471,547.87	32,762,685.05	-

国泰现金管理货币 B:

单位: 人民币元

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
2016	18,714,583.41	3,198,271.93	-2,206,635.01	19,706,220.33	-
2015	27,435,980.74	5,373,480.47	-3,912,530.18	28,896,931.03	-
2014	111,263,503.04	17,162,881.31	7,915,133.79	136,341,518.14	-
合计	157,414,067.19	25,734,633.71	1,795,968.60	184,944,669.50	-

§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 2016 年 12 月 31 日, 本基金管理人共管理 78 只开放式证券投资基金: 国泰金鹰增长混合型证券投资基金、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)、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、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、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金(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、国泰价值经典混合型证券投资基金(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、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、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、国泰估值优势混合型证券投资基金（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、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰福益灵活配置混合型证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰景益灵活配置混合型证券投资基金、国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰

民惠收益定期开放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，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 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩哲昊	本基金的基金经理、国泰货币市场、国泰民安增利债券、国泰上证 5 年期国债 ETF、国泰上证 5 年期国债 ETF 联接、国泰创利债券、国泰润利纯债债券、国泰润泰纯债债券、国泰利是宝货币、国泰现金宝货币的基金经理	2015-06-04	-	7 年	硕士。2010 年 9 月至 2011 年 9 月在旻盛投资有限公司工作，任交易员。2011 年 9 月加入国泰基金管理有限公司，历任债券交易员、基金经理助理。2015 年 6 月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理，2015 年 6 月至 2017 年 3 月任国泰信用债券型证券投资基金的基金经理，2015 年 7 月至 2017 年 3 月任国泰淘金互联网债券型证券投资基金的基金经理，2015 年 7 月起兼任国泰创利债券型证券投资基金（原国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金）的基金经理，2016 年 12 月起兼任国泰利是宝货币市场基金的基金经理，2017 年 2 月起兼任国泰润利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰润泰纯债债券型证券投资基金和国泰现金宝货币市场基金的基金经理。

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，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

4.3.2 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）本基金管理人所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 ≥ 30 ），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。

4.3.3 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年全年，国内基本面整体偏弱。货币政策态度偏紧，且监管层对于去杠杆态度坚决，央行则通过 MLF、逆回购等释放一定流动性。从全年来看，债券市场收益率前低后高，信用风险事件频发，可谓跌宕起伏。四季度受到美联储加息、再通胀预期、金融机构尤其是银行机构流动性收紧，大行减少融出，中美利差收窄，叠加机构赎回货基和委外产品、国海代持事件等影响令债市承压，各期限品种均出现大幅调整。随后央行通过 MLF 和公开市场逆回购加大流动性投放，并通过窗口指导大行增加对非银机构融出，流动性逐步缓解，市场情绪有所修复，债市止跌反弹。

就本基金操作而言，管理团队及时跟踪持有人申赎安排，以流动性管理为首要任务，采取相对谨慎策略，进一步降低评级低且流动性较差的短融配置比例，并配合较短久期的回购以及存款应对

资金面冲击，在降低组合风险的同时为持有人获取稳定回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰现金管理货币 A 在 2016 年的净值增长率为 2.2349%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

国泰现金管理货币 B 在 2016 年的净值增长率为 2.4800%，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

2017 年从经济基本面来看，年初尽管房地产销售数据下滑，但投资增速居高不下，虽有时滞影响，但较高的投资增速仍超市场预期，预计二季度房地产投资增速开始出现下滑。1 月通胀是高点，PPI 继续向上，预计同比增长 6.5% 附近，PPI 对 CPI 的推动将继续，预计今年一季度 CPI 将会走向高点，全年通胀对债市影响中性。货币政策来看，根据政治局会议和经济工作会议的指导思想将防金融风险 and 去杠杆放在首要位置，预计今年的货币政策将以“真”稳健为主，央行去杠杆脚步不停，锁短放长继续，今年资金面中枢难有明显下行。央行分别于 1 月 24 日和 2 月 3 日上调 MLF 利率和公开市场逆回购利率表明央行去金融杠杆的决心，同时也坐实了货币政策稳中偏紧的转向。2017 年资金面波动或将加剧，整体利率中枢较 2016 年开始抬升。2017 年的债市建立在不破不立的基础上，信用债违约会加大利率债的配置倾向，高抛低吸、灵活仓位是 2017 年的利率债投资主旋律。目前短端价值确定，期限利差低于历史均值，长端则适合博取收益而非趋势性投资。我们认为二季度通胀低位、三季度经济基本面下行压力加大，都有可能引发利率下行，应保持资产的灵活性，随时做好换仓的准备。

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，并制定了相关制度及流程。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的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、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 管理人对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分配利润进行了分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰现金管理货币市场基金（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、基金净值收益率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 审计报告

本报告期的财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告，投资者可以通过登载于本管理人网站的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：国泰现金管理货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	199,007,967.02	864,254,129.79
结算备付金	2,272,727.27	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	762,194,978.51	469,889,175.75
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	762,194,978.51	469,889,175.75
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	110,000,485.00	728,101,932.15
应收证券清算款	-	-
应收利息	4,383,220.12	4,626,377.96
应收股利	-	-
应收申购款	21,170,989.11	195,748.85
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,099,030,367.03	2,067,067,364.50
	本期末	上年度末
负债和所有者权益	2016 年 12 月 31 日	2015 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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	502,022.85	110,972.17
应付管理人报酬	225,263.77	341,689.54

应付托管费	68,261.79	103,542.24
应付销售服务费	63,917.20	48,173.66
应付交易费用	21,634.29	30,288.07
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	720,310.42	3,139,532.10
递延所得税负债	-	-
其他负债	99,014.78	189,005.97
负债合计	1,700,425.10	3,963,203.75
所有者权益：	-	-
实收基金	1,097,329,941.93	2,063,104,160.75
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,097,329,941.93	2,063,104,160.75
负债和所有者权益总计	1,099,030,367.03	2,067,067,364.50

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 1,097,329,941.93 份，其中 A 类基金份额总额 237,807,971.35 份；B 类基金份额总额 859,521,970.58 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰现金管理货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	30,947,832.65	44,945,062.98
1.利息收入	28,970,697.88	35,242,271.03
其中：存款利息收入	11,028,626.75	19,622,328.73
债券利息收入	15,028,037.78	13,413,918.20
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,914,033.35	2,206,024.10

其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,977,134.77	9,702,791.95
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,977,134.77	9,702,791.95
资产支持证券投资收益	-	-
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	5,881,795.51	6,487,180.38
1. 管理人报酬	3,479,910.27	3,711,425.72
2. 托管费	1,054,518.25	1,124,674.36
3. 销售服务费	695,822.51	754,532.68
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	381,423.71	585,119.80
其中：卖出回购金融资产支出	381,423.71	585,119.80
6. 其他费用	270,120.77	311,427.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	25,066,037.14	38,457,882.60
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	25,066,037.14	38,457,882.60

7.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	2,063,104,160.75	-	2,063,104,160.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,066,037.14	25,066,037.14
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）	-965,774,218.82	-	-965,774,218.82
其中：1.基金申购款	8,014,456,215.86	-	8,014,456,215.86
2.基金赎回款	-8,980,230,434.68	-	-8,980,230,434.68
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）	-	-25,066,037.14	-25,066,037.14
五、期末所有者权益（基金净值）	1,097,329,941.93	-	1,097,329,941.93
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	1,721,464,394.04	-	1,721,464,394.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,457,882.60	38,457,882.60
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）	341,639,766.71	-	341,639,766.71
其中：1.基金申购款	10,984,936,725.39	-	10,984,936,725.39
2.基金赎回款	-10,643,296,958.68	-	-10,643,296,958.68
四、本期向基金份额持有人	-	-38,457,882.60	-38,457,882.60

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）	2,063,104,160.75	-	2,063,104,160.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：周向勇，会计机构负责人：倪莹

7.4 报表附注

7.4.1 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”)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[2012]第 1324 号《关于核准国泰现金管理货币市场基金募集的批复》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》和《国泰现金管理货币市场基金基金合同》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人民币 3,279,594,881.46 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 512 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰现金管理货币市场基金基金合同》于 2012 年 12 月 11 日正式生效，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 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《国泰现金管理货币市场基金基金合同》和《国泰现金管理货币市场基金招募说明书》的规定，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰现金管理货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：现金、通知存款、短期融资券、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购、期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。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 2017 年 3 月 24 日批准报出。

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》、《国泰现金管理货币市场基金基金合同》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局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《关于金融机构同业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。

7.4.7 关联方关系

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、基金销售机构
申万宏源集团股份有限公司(“申万宏源”)	基金销售机构、受中国建投控制的公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中国建银投资有限责任公司	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
国泰全球投资管理有限公司	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。

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无通过关联方交易单元进行的交易。

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,479,910.27	3,711,425.72

其中：支付销售机构的客户 维护费	196,512.61	412,833.18
---------------------	------------	------------

注：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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数。}$$

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,054,518.25	1,124,674.36

注：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 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数。}$$

7.4.8.2.3 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		
	2016年1月1日至2016年12月31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
中国银行	34,415.05	290.85	34,705.90
国泰基金管理有限公司	404,427.97	73,913.20	478,341.17
申万宏源	1,420.49	-	1,420.49
合计	440,263.51	74,204.05	514,467.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年12月31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
中国银行	75,891.64	5,186.67	81,078.31

国泰基金管理有限公司	303,868.82	64,451.27	368,320.09
申万宏源	1,667.43	6,860.36	8,527.79
合计	381,427.89	76,498.30	457,926.19

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国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。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 A/B 类基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数。}$$

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无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 B

份额单位：份

关联方名称	国泰现金管理货币B本期末 2016年12月31日		国泰现金管理货币B上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
国泰元鑫资产	-	-	25,000,906.97	1.21%

7.4.8.5 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	上年度可比期间

	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	19,007,967.02	499,721.20	54,254,129.79	326,192.39

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 762,194,978.51 元,无属于第一层次以及第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日:第二层次 469,889,175.75 元,无属于第一层次或第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	762,194,978.51	69.35
	其中: 债券	762,194,978.51	69.35
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	110,000,485.00	10.01
	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	201,280,694.29	18.31

4	其他各项资产	25,554,209.23	2.33
5	合计	1,099,030,367.03	100.00

8.2 债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.69	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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比例取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期末正回购的资金余额未超过基金资产的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	11

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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 120 天。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	21.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.25	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	32.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	21.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	97.83	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

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 240 天。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	50,070,751.00	4.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,110,875.25	6.39
	其中：政策性金融债	70,110,875.25	6.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	642,013,352.26	58.51
8	其他	-	-
9	合计	762,194,978.51	69.46
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	140004	14 付息国债 04	500,000	50,070,751.00	4.56
2	111690048	16 徽商银行 CD003	500,000	49,953,739.03	4.55
3	111695974	16 天津农村商业银行 CD013	500,000	49,792,115.12	4.54
4	111695859	16 青岛银行 CD046	500,000	49,790,418.46	4.54
5	111695891	16 南充商行 CD026	500,000	49,784,570.20	4.54
6	111697874	16 江苏紫金农村商业银行 CD054	500,000	49,501,230.96	4.51
7	111697784	16 富滇银行 CD018	500,000	49,479,439.42	4.51
8	111698895	16 合肥科技农村商业银行 CD026	500,000	49,254,282.11	4.49
9	111680820	16 宁夏银行 CD052	500,000	49,160,766.88	4.48
10	111681062	16 厦门农商行 CD086	500,000	49,138,346.84	4.48

8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1566%
报告期内偏离度的最低值	-0.2415%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0613%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，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 1.00 元。

8.9.2 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受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	4,383,220.12
4	应收申购款	21,170,989.11
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	25,554,209.23

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰现金管理货币 A	127,897	1,859.37	24,903,524.61	10.47%	212,904,446.74	89.53%
国泰现金管理货币 B	6	143,253,661.76	834,972,838.36	97.14%	24,549,132.22	2.86%
合计	127,903	8,579.39	859,876,362.97	78.36%	237,453,578.96	21.64%

9.2 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	国泰现金管理货币 A	209,831.31	0.09%

有本基金	国泰现金管理货币 B	0.00	0.00%
	合计	209,831.31	0.02%

9.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰现金管理货币 A	0
	国泰现金管理货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰现金管理货币 A	0
	国泰现金管理货币 B	0
	合计	0

§10 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	226,495,739.11	1,836,608,421.64
本报告期基金总申购份额	5,279,379,729.24	2,735,076,486.62
减：本报告期基金总赎回份额	5,268,067,497.00	3,712,162,937.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	237,807,971.35	859,521,970.58

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人重大人事变动如下：

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司督察长任职公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，聘任李永梅女士担任公司督察长；

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经

本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，巴立康先生不再担任本基金管理人副总经理，且不再代为履行督察长职务；

2016 年 6 月 8 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十五次会议审议通过，张峰先生不再担任本基金管理人总经理，由公司董事长唐建光先生代为履行总经理职务；

2016 年 7 月 12 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十六次会议审议通过，聘任周向勇先生担任本基金管理人总经理，公司董事长唐建光先生不再代为履行总经理职务。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 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。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 90,000 元，目前的审计机构已提供审计服务的年限为 5 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人机构及高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

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，由公司投研业务部门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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
天风证券	-	-	1,500,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。