

国泰货币市场证券投资基金

2006 年半年度报告

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行

送出日期：二〇〇六年八月二十九日

国泰货币市场证券投资基金 2006 年半年度报告

一、重要提示及目录

（一）重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2006年8月25日复核了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、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。

（二）目录

内容	页码
一、重要提示及目录	1
二、基金简介	2
三、主要财务指标和基金净值表现	3
四、基金管理人报告	4
五、基金托管人报告	6
六、财务会计报告（未经审计）	7
七、基金投资组合报告	13
八、基金份额持有人户数、持有人结构	16
九、开放式基金份额变动情况	17
十、重大事件揭示	17
十一、备查文件目录	18

二、基金简介

（一）基金名称：国泰货币市场证券投资基金

基金简称：国泰货币市场

交易代码：020007

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2005年6月21日

报告期末基金份额总额：833,321,207.92份

基金合同存续期：不定期

（二）基金产品说明

（1）投资目标：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。

（2）投资策略：本基金主要为投资者提供流动性现金管理工具，主要结合短期利率变动，合理安排债券组合期限和类属比例，在保证本金安全性、流动性的前提下，获得超过基准的较高收益。根据对宏观经济指标长期趋势的判断、市场预期相对于趋势偏离的程度和各类金融工具的流动性特征，决定组合中债券与其他资产的比例分布。考虑法律法规的相关规定、各类属资产的到期收益率、税收、相对收益差额及不同类属资产的流动性指标等因素决定债券组合的类属配置。通过期限配置和收益率曲线配置来建立债券组合。

（3）业绩比较基准：一年期银行定期储蓄存款的税后利率，即 $(1 - \text{利息税率}) \times \text{一年期银行定期储蓄存款利率}$ 。

（4）风险收益特征：本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合型基金。

（三）基金管理人

名称：国泰基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道1600号浦项商务广场31楼

邮政编码：200122

办公地址：上海市延安东路700号港泰广场22-23楼

邮政编码：200001

法定代表人：陈勇胜

信息披露负责人：丁昌海

联系电话：021-23060282

传真：021-23060283

电子邮箱：xinxipilu@gtfund.com

（四）基金托管人

名称：中国农业银行

注册地址：北京市海淀区复兴路甲23号

邮政编码：100037

办公地址：北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦7-8层

邮政编码：100037
 法定代表人：杨明生
 信息披露负责人：李芳菲
 联系电话：010-68424199
 传真：010-68424181
 电子邮箱：lifangfei@abchina.com

（五）信息披露情况

信息披露报纸名称：《中国证券报》
 登载半年度报告正文的管理人网址：<http://www.gtfund.com>
 半年度报告置备地点：上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼

（六）注册登记机构

名称：国泰基金管理有限公司登记注册中心
 办公地址：上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

（一）各主要财务指标

	2006年1-6月
基金本期净收益	14,012,429.22元
期末基金资产净值	833,321,207.92元
期末基金份额净值	1.000元
本期净值收益率	0.9475%
累计净值收益率	1.9187%

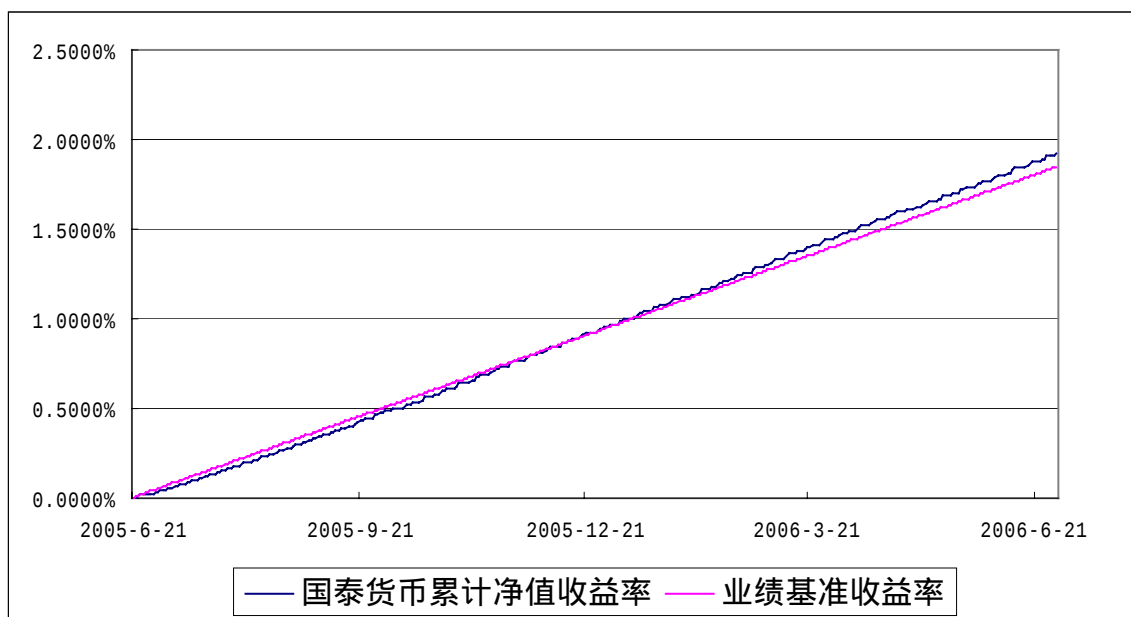
注：本基金收益分配按月结转份额。

（二）基金净值表现

1、国泰货币历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值收益率	净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	0.1542%	0.0066%	0.1479%	0%	0.0063%	0.0066%
过去三个月	0.4637%	0.0055%	0.4488%	0%	0.0149%	0.0055%
过去六个月	0.9475%	0.0053%	0.8926%	0%	0.0549%	0.0052%
过去一年	1.8896%	0.0048%	1.8000%	0%	0.0896%	0.0048%
自基金成立起至今	1.9187%	0.0048%	1.8493%	0%	0.0694%	0.0048%

2、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的历史走势对比图



四、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理介绍

1、基金管理人介绍

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金字[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，并在北京设有分公司。

截至2006年6月30日，本基金管理人共管理4只封闭式证券投资基金：基金金泰、基金金鑫、基金金盛、基金金鼎，以及6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、国泰金象保本增值混合证券投资基金、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。另外，本基金管理人于2004年获得社保基金委托资产管理人资格，目前受托管理社保基金投资组合。

2、基金经理介绍

林勇，男，MBA，9年证券投资从业经历。曾任职招商银行总行资金交易中心人民币投资主管、首席交易员，嘉实基金管理公司基金经理。2005年5月加盟国泰基金管理公司，现任国泰货币市场基金的基金经理。

（二）基金管理合规性声明

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》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，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

报告期内本基金未发生任何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、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，有效保障了投资人的合法权益。

（三）2006年上半年证券市场与投资管理回顾

今年上半年宏观经济总体平稳运行，但贯穿其中的问题是信贷和投资的高增长，特别是进入2季度以来，通胀压力明显加大，经济运行中某些方面开始显露出偏热的特征。

二季度GDP增速达到11.3%，贸易顺差再创历史新高，达到145亿美元。消费仍平稳快速增长，房地产投资有所加快。6月份CPI、PPI和原材料价格分别上涨1.5、3.5和6.6个百分点，同比增幅持续上升。6月份货币信贷增速有所降低，但仍处高位。货币信贷增速回落的主要原因是基数影响，因为去年信贷从6月份开始有明显的放松，当月新增信贷明显增加。

针对上述情况，中央银行采取了一些相应的调控措施，其中包括上调贷款利率和上调法定存款准备金率，使投资者对未来货币政策产生进一步的紧缩预期，货币市场利率持续上升。

（四）2006年下半年证券市场与投资管理展望

预计下半年经济增速将会放缓，CPI 将继续回升，但处于可控范围。货币政策将采取进一步的紧缩措施，货币市场利率将进一步上升，而市场资金总体仍呈宽松局面。

本基金将根据市场变化情况继续完善投资策略，重点关注中央银行货币政策动向和市场流动性变化情况，保持组合剩余期限的稳定，必要的时候及时调整组合结构，保证资产流动性，同时充分利用收益率曲线策略、期限结构套利策略和类属利差策略进行投资品种的选择，争取资金的最佳使用效率，为基金持有人创造稳定、良好的回报。

五、基金托管人报告

在托管国泰货币市场证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》、其他相关法律法规的规定以及《国泰货币市场证券投资基金合同》、《国泰货币市场证券投资基金托管协议》的约定，对国泰货币市场证券投资基金管理人——国泰基金管理有限公司2006年1月1日至2006年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为，国泰基金管理有限公司在国泰货币市场证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人认为，国泰货币市场证券投资基金的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的国泰货币市场证券投资基金2006年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行托管业务部

2006年8月25日

六、 财务会计报告（未经审计）

（一）基金会计报表

1、资产负债表

资产负债表
2006年6月30日

单位：元

	附注	2006年6月30日	2005年12月31日
资 产			
银行存款		67,512,820.22	88,147,932.79
清算备付金		17,555,555.56	6,091,199.84
应收利息	4(1)	806,227.83	2,600,138.02
应收申购款		14,711,110.00	13,416,600.00
其他应收款	4(2)	238,427.00	163,966.00
债券投资市值	4(3)	685,687,349.91	681,352,537.81
其中：债券投资成本		685,687,349.91	681,352,537.81
买入返售证券		50,000,000.00	-
资产总计		836,511,490.52	791,772,374.46
负债及持有人权益			
负债：			
应付管理人报酬		325,828.18	282,173.69
应付托管费		98,735.80	85,507.17
应付销售费		1,128,590.33	767,851.95
应付收益		1,447,510.26	1,337,740.51
其他应付款		95,398.48	-
预提费用	4(4)	94,219.55	175,000.00
负债合计		3,190,282.60	2,648,273.32
持有人权益：			
实收基金	4(5)	833,321,207.92	789,124,101.14
持有人权益合计		833,321,207.92	789,124,101.14
负债及持有人权益总计		836,511,490.52	791,772,374.46

2、经营业绩表

经营业绩表
2006年1-6月

单位：元

项目	附注	2006年1-6月	2005年6月21日-6月30日
一、收入		19,335,811.65	1,933,700.92
1、债券差价收入	4(6)	6,357,010.21	329,993.22
2、债券利息收入		9,595,652.54	214,873.48
3、存款利息收入		617,504.67	518,814.41
4、买入返售证券收入		2,765,644.23	870,019.81
二、费用		5,323,382.43	738,364.88
1、基金管理人报酬		2,439,935.09	339,634.28
2、基金托管费		739,374.31	102,919.46
3、基金销售费		1,848,436.00	257,298.63
4、卖出回购证券支出		102,373.94	-
5、其他费用	4(7)	193,263.09	38,512.51
其中：信息披露费		49,588.57	5,154.60
审计费用		44,630.98	4,536.10
三、基金净收益		14,012,429.22	1,195,336.04
四、基金经营业绩		14,012,429.22	1,195,336.04

3、基金收益分配表

基金收益分配表
2006年1-6月

单位：元

项目	2006年1-6月	2005年6月21日-6月30日
本期基金净收益	14,012,429.22	1,195,336.04
加：期初基金净收益	-	-
加：本期损益平准金	-	-
可供分配基金净收益	14,012,429.22	1,195,336.04
减：本期已分配基金净收益	14,012,429.22	1,195,336.04
期末基金净收益	-	-

4、基金净值变动表

基金净值变动表
2006年1-6月

单位：元

项 目	2006年1-6月	2005年6月21日 -6月30日
一、期初基金净值	789,124,101.14	4,444,937,428.94
二、本期经营活动：		
基金净收益	14,012,429.22	1,195,336.04
未实现利得	-	-
经营活动产生的基金净值变动数	14,012,429.22	1,195,336.04
三、本期基金份额交易：		
基金申购款	3,936,829,331.79	3,218,216.88
基金赎回款	-3,892,632,225.01	-1,690,402,703.99
基金份额交易产生的基金净值变动数	44,197,106.78	-1,687,184,487.11
四、本期向持有人分配收益：		
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-14,012,429.22	-
五、期末基金净值	833,321,207.92	2,758,948,277.87

(二) 基金会计报表附注

1、基金简介

国泰货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）由国泰基金管理有限公司依照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《货币市场基金管理暂行规定》及其他有关规定和基金合同发起，经中国证券监督管理委员会《关于国泰货币市场证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2005]66号文）批准，并于2005年6月21日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期为不定期，基金合同生效日（2005年6月21日）的基金份额总额为4,444,937,428.94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，基金托管人为中国农业银行。有关基金设立等文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《国泰货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天以内(含397天)的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行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货币市场工具。

2、主要会计政策、会计估计及其变更

本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

3、关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

关联方名称	关联关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金注册与过户登记人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
上海国有资产经营有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海爱建信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金管理人的股东
中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
上海仪电控股（集团）公司	基金管理人的股东

注：经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准，本基金管理人股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司，2006年1月13日本基金管理人及时进行了公告，相关工商变更手续尚在办理之中。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的交易（单位：元）

本报告期与通过关联方席位进行的交易：无

(3) 与关联方进行银行间同业市场的债券及回购交易（单位：元）

本报告期与关联方进行银行间同业市场的债券交易及回购交易情况：

	2006年1-6月				
	债券投资	债券正回购		债券逆回购	
	成交金额	成交金额	利息支出	成交金额	利息收入
中国农业银行	331,970,400.00	290,000,000.00	26,917.81	150,000,000.00	46,315.07

	2005年6月21-6月30日				
	债券投资	债券正回购		债券逆回购	
	成交金额	成交金额	利息支出	成交金额	利息收入
中国农业银行	149,881,956.52	-	-	-	-

(4) 基金管理人报酬

基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。
在本报告期内，基金应支付基金管理人管理费共2,439,935.09元，其中已支付基金管理人2,114,106.91元，尚余325,828.18元未支付。2005年6月21日 - 6月30日共计提管理费339,634.28元，已全部支付。

(5) 基金托管人报酬

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的托管人报酬

E为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

本报告期内，基金应支付基金托管人托管费共739,374.31元，其中已支付基金托管人640,638.51元，尚余98,735.80元未支付。2005年6月21日 - 6月30日共计提托管费102,919.46元，已全部支付。

(6) 基金销售费

基金销售费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金销售费

E为前一日的基金资产净值

基金销售机构的销售费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；并于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售机构。

(注：个别销售机构每月发生的销售费用较小，考虑到支付的成本，因此在实际支付过程中，每月金额较小的销售机构采用定期或定额支付的方式。)

本报告期内，基金应支付基金销售费共1,848,436.00元，其中已支付基金销售机构719,845.67元，尚余1,128,590.33元未支付。2005年6月21日 - 6月30日共计提销售费257,298.63元，已全部支付。

销售服务费的关联方及金额

序号	关联方单位	发生额(元)	期末余额(元)
1	国泰基金管理有限公司	979,570.37	670,136.81
2	中国农业银行	513,963.19	256,387.06
3	国泰君安证券股份有限公司	131,118.98	54,878.54
	合 计	1,624,652.54	981,402.41

(7) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于2006年6月30日保管的银行存款余额为67,512,820.22元（2005年6月30日：506,441,727.92元）。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为525,663.93元（2005年6月21日 - 6月30日：518,814.41元）。

(8) 基金各关联方投资本基金的情况

本基金管理人本报告期末持有本基金的情况

本基金管理人在本报告期内及2005年1 - 6月末持有本基金份额。

本基金管理人主要股东及其控制的机构在本报告期末持有本基金情况如下：

	2006年6月30日	
	持有基金份额	占总份额比例
中国电力财务有限公司	1,549,421.23份	0.19%

本基金管理人主要股东及其控制的机构在2005年6月30日未持有本基金。

4、重要会计报表项目说明（单位：元）

(1) 应收利息：

	2006年6月30日
应收银行存款利息	18,124.49
应收清算备付金利息	7,110.00
应收债券利息	775,421.92
应收买入返售证券利息	5,571.42
合计	806,227.83

(2) 其他应收款

	2006年6月30日
应收基金垫付风险金	238,427.00
合计	238,427.00

(3) 投资估值增值按投资类别分别列示如下：

	2006年6月30日
债券投资	-
合计	-

(4) 预提费用：

	2006年6月30日
预提信息披露费	49,588.57
预提审计费用	44,630.98
合计	94,219.55

(5) 实收基金：

2005年12月31日	789,124,101.14
加：本期因申购的增加数	3,936,829,331.79
减：本期因赎回的减少数	3,892,632,225.01
2006年6月30日	833,321,207.92

(6) 债券差价收入：

	2006年1-6月
卖出债券结算金额	2,730,163,967.03
减：卖出债券成本总额	2,713,798,698.15
减：应收利息总额	10,008,258.67
债券差价收入	6,357,010.21

(7) 其他费用：

	2006年1-6月
信息披露费	49,588.57
审计费用	44,630.98
交易所回购交易费用	41,681.06
债券账户服务费	19,230.00
银行间交易手续费	15,398.48
银行费用	22,734.00
合计	193,263.09

5、 流通转让受限制的基金资产

截至2006年6月30日止本基金未持有流通转让受限制的基金资产。

七、 基金投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合

资产组合	金 额(元)	占总资产比例
债券投资	685,687,349.91	81.97%
买入返售证券	50,000,000.00	5.98%
银行存款和清算备付金	85,068,375.78	10.17%
其他资产	15,755,764.83	1.88%
合 计	836,511,490.52	100.00%

(二) 报告期债券回购融资情况

序号	项 目	金额(元)	占基金资产净值的比例
1	报告期内债券回购融资余额	2,056,650,000.00	6.84%
	其中：买断式回购融入的资金	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融入的资金	-	-

注：上表中，报告期内债券回购融资余额为报告期内每日融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

(三) 基金投资组合平均剩余期限

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	167
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	206
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	79

报告期内投资组合平均剩余期限违规超过180天的说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天)	原因	调整期
1	2006年6月17日	188.99	应对赎回	双休日
2	2006年6月18日	188.05	应对赎回	双休日
3	2006年6月19日	183.79	应对赎回	一天
4	2006年6月22日	187.78	应对赎回	两天
5	2006年6月23日	206.32	应对赎回	一天
6	2006年6月24日	205.37	应对赎回	双休日
7	2006年6月25日	204.42	应对赎回	双休日

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	16.21%	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	16.41%	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	16.41%	-
4	90天(含)—180天	9.51%	-
5	180天(含)—397天(含)	56.37%	-
合 计		98.50%	-

(四) 报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例
1	国家债券	-	-
2	金融债券	136,729,083.04	16.41%
	其中：政策性金融债	136,729,083.04	16.41%
3	央行票据	226,800,947.43	27.22%
4	企业债券	322,157,319.44	38.66%
5	其他	-	-
合 计		685,687,349.91	82.28%
剩余存续期超过397天的浮动利息债券		136,729,083.04	16.41%

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。

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值的比例
		自有投资	买断式回购		
1	05农发06	1,150,000	-	116,366,930.79	13.96%
2	06央行票据16	1,000,000	-	98,611,631.25	11.83%
3	05哈药CP01	500,000	-	49,545,181.43	5.95%
4	06央行票据14	500,000	-	49,334,616.32	5.92%
5	06央行票据22	500,000	-	49,230,735.13	5.91%
6	06明珠CP01	350,000	-	34,520,465.73	4.14%
7	06金桥CP01	300,000	-	30,149,842.42	3.62%
8	06央行票据08	300,000	-	29,623,964.73	3.55%
9	04国开20	200,000	-	20,362,152.25	2.44%
10	06百联CP01	200,000	-	20,119,608.41	2.41%

注：上表中，“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

(五) “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	21
报告期内偏离度的最高值	0.37%
报告期内偏离度的最低值	-0.31%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.15%

(六) 投资组合报告附注

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,按票面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。

2、本报告期内货币市场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声明

报告期内,本基金没有出现持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本占基金资产净值比例超过20%的情况。

3、本报告期内需说明的证券投资决策程序。

报告期内,基金管理人的投资决策严格按照招募说明书和基金合同进行,没有需要特别说明和补充的部分。

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收到公开谴责,处罚的情况。

4、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	应收利息	806,227.83
2	应收申购款	14,711,110.00
3	其他应收款	238,427.00
合 计		15,755,764.83

5、本报告期内未投资资产支持证券。

八、基金份额持有人户数、持有人结构

(一) 持有人户数

基金份额持有人户数:10,044

平均每户持有人基金份额:82,967.07份

(二) 持有人结构

	持有的基金份额(份)	占总份额比例
机构投资者	449,654,821.70	53.96%
个人投资者	383,666,386.22	46.04%
合 计	833,321,207.92	100.00%

九、开放式基金份额变动情况

	份额（份）
报告期初基金份额总额	789,124,101.14
报告期间基金总申购份额	3,936,829,331.79
报告期间基金总赎回份额	3,892,632,225.01
报告期末基金份额总额	833,321,207.92

十、重大事件揭示

- 1、2006年1月13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关于公司股东股权转让的公告》，经中国证监会证监基金字[2006]4号文批准，本基金管理人股东浙江省国际信托投资有限责任公司将其所持有的本公司20%股权全部转让给万联证券有限责任公司。
- 2、2006年4月24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关于增加代销机构的公告》，增加了中信万通证券有限责任公司为本基金的代销机构。
- 3、2006年5月26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关于增加代销机构的公告》，增加了中信证券股份有限公司为本基金的代销机构。
- 4、2006年6月14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关于旗下基金投资资产支持证券投资方案的公告》，就本基金投资资产支持证券的方案等事项进行了公告。
- 5、2006年6月23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关于增加代销机构的公告》，增加了华泰证券有限责任公司为本基金的代销机构为本基金的代销机构。
- 6、报告期内，基金租用证券公司专用席位的有关情况如下：

券商名称	席位数量	债券成交金额	比例	债券回购成交金额	比例	佣金	比例
光大证券有限责任公司	1	-	-	7,446,100,000.00	100.00%	-	-
合计	1	-	-	7,446,100,000.00	100.00%	-	-

- 7、报告期内基金收益分配事项如下：

(1)本报告期(2006年1-6月)累计收益分配金额：14,012,429.22元。

(2)日常情况下的收益分配规则：

每周五进行收益分配时，将同时分配周六和周日的收益；每周一至周四进行收益分配时，则仅对当日收益进行分配。

投资者于周五申购的基金份额不享有周五和周六、周日的收益；投资者于周五赎回的基金份额享有周五和周六、周日的收益。

(3)法定节假日的收益分配规则：

法定节假日前最后一个开放日的收益将与整个节假日期间的收益合并后于法定节假日最后一日进行分配；法定节假日结束后第一个开放日起的收益分配规则同日常情况下的收益分配规则。

投资者于法定节假日前最后一个开放日申购的基金份额不享有该日和整个节假日期间的收益；投资者于法定节假日前最后一个开放日赎回的基金份额享有该日和整个节假日期间的收益。

- 8、报告期内，未召开基金份额持有人大会；基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动；无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项；基金投资策略无改变；为本基金提供审计服务的会计事务所无改聘情况；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。

十一、 备查文件目录

- 1、关于同意设立国泰货币市场证券投资基金的批复
- 2、国泰货币市场证券投资基金合同
- 3、国泰货币市场证券投资基金托管协议
- 4、国泰货币市场证券投资基金半年度报告、年度报告及收益分配公告
- 5、国泰货币市场证券投资基金代销协议
- 6、报告期内披露的各项公告
- 7、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

备查文件存放地点：本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市延安东路 700 号港泰广场 22-23 楼。

投资者查阅方式：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) 33134688，400-8888-688

客户投诉电话：(021) 23060279

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2006 年 8 月 29 日