

# 国泰货币市场证券投资基金 更新招募说明书摘要

（2010 年第一号）

**基金管理人：国泰基金管理有限公司**

**基金托管人：中国农业银行股份有限公司**

## 重要提示

本基金的募集申请已于 2005 年 4 月 25 日获中国证监会证监基金字[2005]66 号文批准。本基金的基金合同于 2005 年 6 月 21 日正式生效。

国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“基金管理人”）保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会审核同意，但中国证监会对本基金募集的核准，均不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人公司不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金，必须自担风险。

投资有风险，投资者拟申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

本摘要根据本基金的基金合同和更新基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同

及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2010 年 6 月 21 日，投资组合报告为 2010 年 1 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 12 月 31 日。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：国泰基金管理有限公司

成立日期：1998 年 3 月 5 日

住所：上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼

法定代表人：陈勇胜

注册资本：1.1 亿元人民币

联系人：何晔

联系电话：（021）38561743

股本结构：

| 股东名称         | 股权比例 |
|--------------|------|
| 中国建银投资有限责任公司 | 60%  |
| 意大利忠利集团      | 30%  |
| 中国电力财务有限公司   | 10%  |

### （二）基金管理人管理基金的基本情况

截至 2010 年 6 月 21 日，本基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金，以及 14 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（二期）、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）、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金。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 24 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。

### （三）主要人员情况

#### 1、董事会成员：

陈勇胜，董事长，硕士研究生，高级经济师，18 年证券从业经历。1982 年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理（主持工作）。1992 年起任国泰证券有限公司国际业务部总经理，公司总经理助理兼北京分公司总经理，1998 年 3 月起任国泰基金管理有限公司董事、总经理，1999 年 10 月起任公司董事长、党委书记。

陈良秋，董事，大学本科。1993 年 7 月起在中国建设银行厦门市分行工作，历任业务科副经理、办公室副总经理、支行副行长、行长。2006 年 10 月起在中国建投工作，任企业管理部总经理助理、副总经理、投资部负责人，兼任中投科信科技股份有限公司董事。2007 年 11 月起任公司董事。

梁凤玉，董事，硕士研究生，高级会计师。1994 年 8 月至 2006 年 7 月，在中国建设银行辽宁省分行工作，历任葫芦岛分行房贷部副主任、城内支行副行长、葫芦岛分行国际业务部副主任、计划财务部副主任；辽宁省分行计划财务部副主任科员、四级财务分析师。2006 年 7 月起在中国建投工作，其间曾任中国投资咨询公司财务总监。现任中国建投财务会计部计划财务一处副高级经理。2009 年 12 月起任公司董事。

张和之，董事，硕士研究生、高级会计师。曾任水利电力部机关财务处主任科员，能源部机关财务处副处长，电力部机关事务局经营财务处处长，国家电力公司中兴实业发展总公司副总经理、总会计师、副董事长、中国电力财务有限公司副董事长、党组副书记（正局级）、正局级调研员。2004 年 2 月起任公司董事。

王耀南，董事，大专，17 年证券从业经历。1993 年至 1997 年任职广州珠江信托投资公司证券部。1997 年至 2001 年任职广州珠江实业集团财务公司。2001 年至今在万联证券有限

责任公司，历任办公室主任、工会主席、行政总监、董事、党总支书记。2006 年 4 月起任公司董事。

金旭，董事，硕士研究生，17 年证券从业经历。1993 年 7 月至 2001 年 11 月在中国证监会工作，历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001 年 11 月至 2004 年 7 月在华夏基金管理有限公司任党支部副书记、副总经理。2004 年 7 月至 2006 年 1 月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006 年 1 月至 2007 年 5 月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007 年 5 月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007 年 11 月起任公司董事、党委副书记。

龚浩成，独立董事，硕士研究生，教授。长期从事金融证券研究和管理，1979 起历任上海财经学院副教授、教授、副院长，中国人民银行上海分行副行长、行长，国家外汇管理局上海市分局副局长、局长，上海证券交易所常务理事（主持理事会工作），上海证券期货学院院长、教授。2001 年 5 月起任公司独立董事。

曹尔阶，独立董事，大学本科，研究员。长期从事金融证券研究和管理，1979 年起历任中国建设银行总行投资研究所副所长、中国建设银行总行投资调查部主任、中国投资咨询公司总经理、中国国际金融公司高级顾问等。2001 年 5 月起任公司独立董事。

吴鹏，独立董事，博士研究生。著名律师，执业范围包括金融证券。曾在日本著名律师事务所从事与中国相关法律工作，日本西南大学讲授中国法律。1993 年回国从事律师工作，现为北京中伦律师事务所合伙人，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员。2001 年 5 月起任公司独立董事。

## 2、监事会成员：

万树斌，监事会主席，大学本科，高级会计师。1984 年起在中国建设银行总行工作，历任会计部副处长、计财部副处长、处长、资债部高级经理。2005 年 1 月起任中国建投财会部副总经理，兼任建投中信资产管理公司监事长。2007 年 11 月起任公司监事会主席。

李芝樑，监事，硕士研究生。曾任中建一局集团第五建筑工程公司宣传部干事，中国电力财务有限公司债券基金部副经理、经理，投资银行部主任，发展研究中心主任兼董事会办公室常务副主任。现任中国电力财务有限公司董事会办公室主任。2004 年 2 月起任公司监事。

黄晓坤，监事，博士研究生，经济师。8 年证券从业经历。1996 年 7 月起在广州五星化工厂任工程师。2000 年 4 月起在广东省电信公司任研究员。2001 年 6 月起任南方证券高级经理。2004 年 5 月起任银华基金管理有限公司高级经理。2005 年 10 月起任万联证券研究发

展中心总经理，万联证券副总裁。2007 年 11 月起任公司监事。

王骏，监事，硕士研究生。曾任国泰君安证券公司会计、清算部经理，2001 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，从事基金登记核算工作，现任运营管理部总监。2007 年 11 月起任公司职工监事。

张晖，监事，硕士研究生。1991 年 7 月至 1994 年 10 月，在江苏省扬州市外贸公司进口部工作。1994 年 10 月至 2000 年 3 月，在招商银行深圳管理部工作，任档案室主任。2001 年 2 月至 2009 年 8 月，在宝盈基金工作，任总经理助理、董事会秘书。2009 年 8 月加入国泰基金，任总经理助理和职工监事。

### 3、高级管理人员：

陈勇胜，董事长，简历情况见董事会成员介绍。

金旭，总经理，简历情况见董事会成员介绍。

巴立康，硕士研究生，高级会计师，17 年证券从业经历。1993 年 4 月至 1998 年 4 月在华夏证券工作，历任营业部财务经理、公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理。1998 年 4 月至 2007 年 11 月在华夏基金管理有限公司工作，历任综合管理部总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。现任公司副总经理。

初伟斌，硕士研究生，16 年证券从业经历。1992 年 8 月至 1996 年 5 月在中国注册会计师协会工作，1996 年 5 月至 2003 年 9 月在中国证监会任基金监管部副处长，2003 年 9 月至 2008 年 6 月在景顺长城基金管理有限公司工作，历任法律监察稽核总监、副总经理。现任公司副总经理。

梁之平，本科，13 年证券从业经历。曾任国泰君安证券股份有限公司国际业务部研究部经理，大成基金管理有限公司基金运营部总监、市场部总监兼客户服务中心总监、委托投资部总监，2008 年 3 月加入国泰基金管理有限公司，任总经理助理兼财富管理中心总经理，现任公司副总经理。

李峰，硕士研究生，14 年银行证券基金从业经历。曾任荷兰商业银行上海分行中国区监察主管，国联安基金管理有限公司监察稽核专员，信诚基金管理有限公司督察长，美国雷曼兄弟亚洲投资有限公司上海代表处中国区合规总监。2009 年 2 月加盟国泰基金管理有限公司，现任公司督察长。

### 4、本基金基金经理

#### （1）现任基金经理

翁锡赞，男，硕士，6 年证券基金从业经验。曾就职于兴业基金公司、万家基金公司。

2008 年 7 月加盟国泰基金管理有限公司,2008 年 8 月起担任国泰货币基金的基金经理,2010 年 6 月起兼任国泰金鹿保本混合基金的基金经理。

(2) 历任基金经理情况

2005 年 5 月至 2005 年 10 月由张顺太担任本基金的基金经理,2005 年 11 月至 2007 年 2 月由林勇担任本基金的基金经理,2007 年 2 月至 2008 年 8 月由高红兵担任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会,其成员在公司总经理、分管副总经理、投资总监、研究开发部、固定收益部、基金管理部、财富管理中心、市场体系等负责人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员,督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同,审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则,以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下:

金旭女士: 总经理

余荣权先生: 拟任副总经理

梁之平先生: 副总经理兼财富管理中心总经理

张人蟠先生: 总经理助理

刘夫先生: 固定收益类资产投资副总监兼财富管理中心投资总监

沙骏先生: 研究部总监兼交易管理部总监

张则斌先生: 财富管理中心投资副总监

黄焱先生: 基金管理部副总监

张玮先生: 基金管理部总监助理

6、上述成员之间均不存在近亲属或家属关系。

## 二、基金托管人

(一) 基本情况

名称: 中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心

法定代表人：项俊波

成立日期：2009 年 1 月 15 日

注册资本：2700 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## （二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 130 名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## （三）基金托管业务经营情况

截止 2010 年 6 月 21 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 77 只，包括国泰货币市场证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、

中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、直销机构

| 序号 | 机构名称             | 机构信息                             |                   |
|----|------------------|----------------------------------|-------------------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司上海直销柜台 | 地址：上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼     |                   |
|    |                  | 电话：021-38561759                  | 传真：021-687758810  |
|    |                  | 客户服务专线：400-888-8688，021-38569000 |                   |
|    |                  | 联系人：蔡丽萍                          | 网址：www.gtfund.com |
| 2  | 国泰基金管理有限公司北京直销柜台 | 地址：中国北京市西城区金融大街7号第5层             |                   |
|    |                  | 电话：010-66553055                  | 传真：010-66553082   |
|    |                  | 联系人：魏文                           |                   |
| 3  | 国泰基金电子交易平台       | 网站：www.gtfund.com 登录网上交易页面       |                   |
|    |                  | 电话：021-38561735                  | 联系人：杨荣华           |

##### 2、代销机构

| 序号 | 机构名称         | 机构信息                           |                                                |
|----|--------------|--------------------------------|------------------------------------------------|
| 1  | 中国银行股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号            |                                                |
|    |              | 法定代表人：肖钢                       | 联系人：客户服务中心                                     |
|    |              | 客服电话：95566                     | 网址： <a href="http://www.boc.cn">www.boc.cn</a> |
| 2  | 中国建设银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街25号             |                                                |
|    |              | 办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼         |                                                |
|    |              | 法定代表人：郭树清                      | 客服电话：95533                                     |
|    |              | 网址：www.ccb.com                 |                                                |
| 3  | 中国农业银行股份有限公司 | 注册地址：北京市东城区建国门内大街69号           |                                                |
|    |              | 办公地址：北京市东城区建国门内大街69号           |                                                |
|    |              | 法定代表人：项俊波                      | 客户服务电话：95599                                   |
|    |              | 联系人：滕涛                         | 传真：010-85109219                                |
|    |              | 网址：www.95599.cn                |                                                |
| 4  | 中国工商银行股份有限公司 | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005） |                                                |
|    |              | 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005） |                                                |
|    |              | 法定代表人：姜建清                      | 电话：95588                                       |

|    |                |                                                                            |                                                            |
|----|----------------|----------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
|    |                | 网址: <a href="http://www.icbc.com.cn">www.icbc.com.cn</a>                   |                                                            |
| 5  | 交通银行股份有限公司     | 注册地址: 上海市银城中路188号                                                          |                                                            |
|    |                | 法定代表人: 胡怀邦                                                                 | 客服电话: 95559                                                |
|    |                | 联系人: 曹榕                                                                    | 电话: 021-58781234                                           |
|    |                | 网址: <a href="http://www.bankcomm.com">www.bankcomm.com</a>                 |                                                            |
| 6  | 招商银行股份有限公司     | 注册地址: 深圳市深南大道7088号招商银行大厦                                                   |                                                            |
|    |                | 法定代表人: 秦晓                                                                  | 联系人: 丰靖                                                    |
|    |                | 电话: 0755-83198888                                                          | 传真: 0755-83195109                                          |
|    |                | 客户服务热线: 95555                                                              | 网址: <a href="http://www.cmbchina.com">www.cmbchina.com</a> |
| 7  | 华夏银行股份有限公司     | 注册地址: 北京市东城区建国门内大街 22 号                                                    |                                                            |
|    |                | 办公地址: 北京市东城区建国门内大街 22 号                                                    |                                                            |
|    |                | 法定代表人: 吴建                                                                  | 客服服务热线: 95577                                              |
|    |                | 网址: <a href="http://www.hxb.com.cn">www.hxb.com.cn</a>                     |                                                            |
| 8  | 中信银行股份有限公司     | 注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座                                                 |                                                            |
|    |                | 法定代表人: 孔丹                                                                  | 联系人: 丰靖                                                    |
|    |                | 电话: 010-65557083                                                           | 传真: 010-65550827                                           |
|    |                | 客服电话: 95558                                                                | 网址: <a href="http://bank.ecitic.com">bank.ecitic.com</a>   |
| 9  | 中国民生银行股份有限公司   | 注册地址: 北京市西城区复兴门内大街2号                                                       |                                                            |
|    |                | 法定代表人: 董文标                                                                 | 联系人: 董云巍、吴海鹏                                               |
|    |                | 电话: 010-58351666                                                           | 传真: 010-83914283                                           |
|    |                | 客服电话: 95568                                                                | 网址: <a href="http://www.cmbc.com.cn">www.cmbc.com.cn</a>   |
| 10 | 北京银行股份有限公司     | 注册地址: 北京市西城区金融大街17号                                                        |                                                            |
|    |                | 法定代表人: 阎冰竹                                                                 | 联系人: 王曦                                                    |
|    |                | 电话: 010-66223584                                                           | 传真: 010-66226073                                           |
|    |                | 客服电话: 010-96169                                                            |                                                            |
|    |                | 网址: <a href="http://www.bankofbeijing.com.cn">www.bankofbeijing.com.cn</a> |                                                            |
| 11 | 上海农村商业银行股份有限公司 | 注册地址: 上海市浦东新区浦东大道981号                                                      |                                                            |
|    |                | 法定代表人: 李秀仑                                                                 | 联系人: 吴海平                                                   |
|    |                | 电话: 021-38576977                                                           | 传真: 021-50105124                                           |
|    |                | 客服电话: 021-962999                                                           | 网址: <a href="http://www.srcb.com">www.srcb.com</a>         |
| 12 | 中国建银投资证券有限责任公司 | 注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层                                     |                                                            |
|    |                | 法定代表人: 杨明辉                                                                 | 联系人: 刘权                                                    |

|    |                  |                                 |                    |
|----|------------------|---------------------------------|--------------------|
|    |                  | 电话：0755-82026521                | 客服电话：400-600-8008  |
|    |                  | 网址：www.cjis.cn                  |                    |
| 13 | 国泰君安证券股份<br>有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区商城路618号             |                    |
|    |                  | 法定代表人：祝幼一                       | 联系人：芮敏祺            |
|    |                  | 电话：021-38676161                 | 传真：021-38670161    |
|    |                  | 客服电话：400-888-8666               | 网址：www.gtja.com    |
| 14 | 宏源证券股份有限<br>公司   | 注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号宏源大厦     |                    |
|    |                  | 法定代表人：冯戎                        | 联系人：李茂俊            |
|    |                  | 电话：010-62294608                 | 传真：010-62296854    |
|    |                  | 客服电话：400-800-0562               | 网址：www.hysec.com   |
| 15 | 万联证券有限责任<br>公司   | 注册地址：广州市中山二路18号电信广场36、37层       |                    |
|    |                  | 法定代表人：张建军                       | 联系人：罗创斌            |
|    |                  | 电话：020-37865017                 | 传真：020-37865030    |
|    |                  | 客服电话：400-888-8133               | 网址：www.wlzq.com.cn |
| 16 | 中信建投证券有限<br>责任公司 | 注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼            |                    |
|    |                  | 法定代表人：张佑君                       | 联系人：魏明             |
|    |                  | 电话：010-85130588                 | 传真：010-65182261    |
|    |                  | 客服电话：400-888-8108               | 网址：www.csc108.com  |
| 17 | 海通证券股份有限<br>公司   | 注册地址：上海市淮海中路98号                 |                    |
|    |                  | 法定代表人：王开国                       | 联系人：李笑鸣            |
|    |                  | 电话：021-23219000                 | 传真：021-23219100    |
|    |                  | 客服电话：400-888-8001（全国），021-95553 |                    |
|    |                  | 网址：www.htsec.com                |                    |
| 18 | 中国银河证券股份<br>有限公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座      |                    |
|    |                  | 法定代表人：顾伟国                       | 联系人：田薇             |
|    |                  | 电话：010-66568430                 | 传真：010-66568536    |
|    |                  | 网址：www.chinastock.com.cn        |                    |
| 19 | 中信金通证券有限<br>责任公司 | 注册地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座        |                    |
|    |                  | 法定代表人：刘军                        | 联系人：俞会亮            |
|    |                  | 电话：0571-85776115                | 客服电话：0571-96598    |
|    |                  | 网址：www.bigsun.com.cn            |                    |
| 20 | 申银万国证券股份<br>有限公司 | 注册地址：上海市常熟路171号                 |                    |
|    |                  | 法定代表人：丁国荣                       | 联系人：邓寒冰            |
|    |                  | 电话：021-54033888                 | 传真：021-54038844    |

|    |            |                                    |                      |
|----|------------|------------------------------------|----------------------|
|    |            | 客服电话：021-962505                    | 网址：www.sw2000.com.cn |
| 21 | 东方证券股份有限公司 | 注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层         |                      |
|    |            | 法定代表人：王益民                          | 联系人：吴宇               |
|    |            | 电话：021-63325888                    | 传真：021-63326173      |
|    |            | 客服电话：95503                         | 网址：www.dfzq.com.cn   |
| 22 | 东吴证券股份有限公司 | 注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦             |                      |
|    |            | 法定代表人：吴永敏                          | 联系人：方晓丹              |
|    |            | 电话：0512-65581136                   | 传真：0512-65588021     |
|    |            | 客服电话：0512-33396288                 | 网址：www.dwzq.com.cn   |
| 23 | 广发证券股份有限公司 | 注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼           |                      |
|    |            | 办公地址：广东广州天河北路大都会广场36、41和42楼        |                      |
|    |            | 法定代表人：王志伟                          | 联系人：黄岚               |
|    |            | 电话：020-87555888                    | 传真：020-87555305      |
|    |            | 客服电话：95575                         | 网址：www.gf.com.cn     |
| 24 | 国盛证券有限责任公司 | 注册地址：江西省南昌市永叔路15号                  |                      |
|    |            | 办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼       |                      |
|    |            | 法定代表人：管荣升                          | 联系人：徐美云              |
|    |            | 电话：0791-6285337                    | 传真：0791-6288690      |
|    |            | 网址：www.gsstock.com                 |                      |
| 25 | 民生证券有限责任公司 | 注册地址：北京市朝阳区朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室    |                      |
|    |            | 法定代表人：岳献春                          | 联系人：赵明               |
|    |            | 电话：010-85252656                    | 传真：010-85252655      |
|    |            | 客服电话：400-619-8888                  | 网址：www.msza.com      |
| 26 | 上海证券有限责任公司 | 注册地址：上海市西藏中路336号                   |                      |
|    |            | 法定代表人：郁忠民                          | 联系人：张瑾               |
|    |            | 电话：021-53519888                    | 传真：021-53519888      |
|    |            | 客服电话：021-962518                    | 网址：www.962518.com    |
| 27 | 光大证券股份有限公司 | 注册地址：上海市静安区新闻路1508号                |                      |
|    |            | 法定代表人：徐浩明                          | 联系人：刘晨               |
|    |            | 电话：021-22169999                    | 传真：021-22169134      |
|    |            | 客服电话：10108998、400-888-8788         |                      |
|    |            | 网址：www.ebscn.com                   |                      |
| 28 | 中信万通证券有限   | 注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层1507-1510 |                      |

|    |              |                                    |                    |
|----|--------------|------------------------------------|--------------------|
|    |              | 办公地址：青岛市东海西路28号                    |                    |
|    |              | 法定代表人：史洁民                          | 联系人：刘光明            |
|    |              | 电话：0532-85022273                   | 传真：0532-85022605   |
|    |              | 客服电话：0532-96577                    | 网址：www.zxwt.com.cn |
| 29 | 中信证券股份有限公司   | 注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层       |                    |
|    |              | 法定代表人：王东明                          | 联系人：陈忠             |
|    |              | 电话：010-84588888                    | 传真：010-84865560    |
|    |              | 网址：www.ecitic.com                  |                    |
| 30 | 华泰证券有限责任公司   | 注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦           |                    |
|    |              | 办公地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦           |                    |
|    |              | 法定代表人：吴万善                          | 联系人：张小波            |
|    |              | 电话：025-84457777                    | 网址：www.htzq.com.cn |
|    |              | 客服电话：95597                         |                    |
| 31 | 长江证券股份有限公司   | 注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦               |                    |
|    |              | 法定代表人：胡运钊                          | 联系人：李良             |
|    |              | 电话：021-63219781                    | 传真：021-51062920    |
|    |              | 客服电话：400-888-8999、027-85808318     |                    |
|    |              | 网址：www.95579.com                   |                    |
| 32 | 国海证券有限责任公司   | 注册地址：广西南宁市滨湖路46号                   |                    |
|    |              | 法定代表人：张雅锋                          | 联系人：武斌             |
|    |              | 电话：0755-83707413                   | 传真：0755-83700205   |
|    |              | 客服电话：400-888-8100（全国）、96100（广西）    |                    |
|    |              | 网址：www.ghzq.com.cn                 |                    |
| 33 | 渤海证券股份有限公司   | 注册地址：天津市经济技术开发区第一大街29号             |                    |
|    |              | 办公地址：天津市河西区宾水道3号                   |                    |
|    |              | 法定代表人：王春峰                          | 联系人：王兆权            |
|    |              | 电话：022-28451861                    | 传真：022-28451892    |
|    |              | 客服电话：400-651-5988                  | 网址：www.ewww.com.cn |
| 34 | 华泰联合证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、25层 |                    |
|    |              | 法定代表人：马昭明                          | 联系人：盛宗凌            |
|    |              | 电话：0755-82492000                   | 传真：0755-82492962   |
|    |              | 客服电话：400-888-8555或95513            |                    |
|    |              | 网址：www.lhzq.com                    |                    |

|    |            |                                     |                      |
|----|------------|-------------------------------------|----------------------|
| 35 | 中原证券股份有限公司 | 注册地址：郑州市经三路15号广汇国际贸易大厦              |                      |
|    |            | 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号17层             |                      |
|    |            | 法定代表人：石保上                           | 联系人：程月艳、耿铭           |
|    |            | 电话：0371-65585670                    | 传真：0371-65585665     |
|    |            | 客服电话：400-813-9666/0371-967218       |                      |
|    |            | 网址：www.ccnew.com                    |                      |
| 36 | 国信证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼    |                      |
|    |            | 法定代表人：何如                            | 联系人：齐晓燕              |
|    |            | 电话：0755-82130833                    | 传真：0755-82133302     |
|    |            | 客服电话：95536                          | 网址：www.guosen.com.cn |
| 37 | 招商证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层          |                      |
|    |            | 法定代表人：宫少林                           | 联系人：黄健               |
|    |            | 电话：0755-82943666                    | 传真：0755-82943636     |
|    |            | 网址：www.newone.com.cn                |                      |
| 38 | 兴业证券股份有限公司 | 注册地址：福建省福州市湖东路268号证券大厦              |                      |
|    |            | 法定代表人：兰荣                            | 联系人：谢高得              |
|    |            | 电话：021-38565785                     | 传真：021-38565783      |
|    |            | 客服电话：400-888-8123                   |                      |
|    |            | 网址：www.xyzq.com.cn                  |                      |
| 39 | 齐鲁证券有限公司   | 注册地址：山东省济南市经十路20518号                |                      |
|    |            | 办公地址：山东省济南市经十路20518号                |                      |
|    |            | 法定代表人：李玮                            | 联系人：傅咏梅              |
|    |            | 电话：0531-81283728                    | 传真：0531-81283735     |
|    |            | 客服电话：95538                          | 网址：www.qlzq.com.cn   |
| 40 | 安信证券股份有限公司 | 注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元 |                      |
|    |            | 法定代表人：牛冠兴                           | 联系人：张勤               |
|    |            | 联系电话：021-68801217                   | 传真：021-68801119      |
|    |            | 客服电话：400-800-1001                   |                      |
| 41 | 东莞证券有限责任公司 | 注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼            |                      |
|    |            | 法定代表人：游锦辉                           | 联系人：梁健伟              |

|    |                  |                                |                      |
|----|------------------|--------------------------------|----------------------|
|    |                  | 电话：0796-22100159               | 传真：0769-22119423     |
|    |                  | 客服电话：0769-961130               | 网址：www.dgzq.com.cn   |
| 42 | 恒泰证券股份有限<br>公司   | 注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号       |                      |
|    |                  | 法定代表人：刘汝军                      | 联系人：常向东              |
|    |                  | 电话：0471-4913998                | 传真：0471-4930707      |
|    |                  | 客服电话：0471-4961259              | 网址：www.cnht.com.cn   |
| 43 | 世纪证券有限责任<br>公司   | 注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼  |                      |
|    |                  | 法定代表人：卢长才                      | 联系人：王飞               |
|    |                  | 电话：0755-83199511               | 客服电话：0755-83199511   |
|    |                  | 传真：0755-83199545               | 网址：www.cscs.com.cn   |
| 44 | 厦门证券有限公司         | 注册地址：厦门市莲前西路二号莲富大厦十七楼          |                      |
|    |                  | 法定代表人：傅毅辉                      | 联系人：叶朝辉              |
|    |                  | 电话：0592-5161816                | 传真：0592-5161102      |
|    |                  | 客服电话：0592-5163588              | 网址：www.xmzq.cn       |
| 45 | 华宝证券有限责任<br>公司   | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层 |                      |
|    |                  | 法定代表人：陈林                       | 联系人：刘闻川              |
|    |                  | 电话：021-50122222                | 传真：021-50122200      |
|    |                  | 客服电话：021-38929908              | 网址：www.cnhbstock.com |
| 46 | 英大证券有限责任<br>公司   | 注册地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层     |                      |
|    |                  | 法定代表人：赵文安                      | 联系人：王睿               |
|    |                  | 电话：0755-83007069               | 传真：0755-83007167     |
|    |                  | 客服电话：400-869-8698              | 网址：www.ydsc.com.cn   |
| 47 | 中国国际金融有限<br>公司   | 注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  |                      |
|    |                  | 法定代表人：李剑阁                      | 联系人：邓力伟              |
|    |                  | 电话：010-65051166                | 传真：010-65051156      |
|    |                  | 网址：www.cicc.com.cn             |                      |
| 48 | 广发华福证券有限<br>责任公司 | 注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层       |                      |
|    |                  | 法定代表人：黄金琳                      | 联系人：张腾               |
|    |                  | 电话：0591-87278701               | 传真：0591-87841150     |

|    |              |                                   |                      |
|----|--------------|-----------------------------------|----------------------|
|    |              | 客服电话：0591-96326                   | 网址：www.gfhfzq.com.cn |
| 49 | 天相投资顾问有限公司   | 注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701        |                      |
|    |              | 法定代表人：林义相                         | 联系人：莫晓丽              |
|    |              | 电话：010-66045566                   | 传真：010-66045500      |
|    |              | 客服电话：010-66045678                 | 网址：www.txsec.com     |
| 50 | 信达证券股份有限公司   | 注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼            |                      |
|    |              | 法定代表人：张志刚                         | 联系人：唐静               |
|    |              | 电话：010-88656100                   | 传真：010-88656290      |
|    |              | 客服电话：400-800-8899                 | 网址：www.cindasc.com   |
| 51 | 中国民族证券有限责任公司 | 注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6-9层       |                      |
|    |              | 法定代表人：赵大建                         | 联系人：姜建平              |
|    |              | 电话：010-59355543                   | 传真：010-66553791      |
|    |              | 客服电话：400-889-5618                 | 网址：www.e5618.com     |
| 52 | 华龙证券有限责任公司   | 注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号                |                      |
|    |              | 法定代表人：李晓安                         | 联系人：李昕田              |
|    |              | 电话：0931-8888088                   | 传真：0931-4890515      |
|    |              | 客服电话：0931-4890100、4890619、4890618 |                      |
|    |              | 网址：www.hlzqgs.com                 |                      |
| 53 | 国元证券股份有限公司   | 注册地址：安徽省合肥市寿春路179号                |                      |
|    |              | 法定代表人：凤良志                         | 联系人：李飞               |
|    |              | 电话：0551-2207323                   | 传真：0551-2207322      |
|    |              | 客服电话：95578                        | 网址：www.gyzq.com.cn   |
| 54 | 杭州银行股份有限公司   | 注册地址：杭州市庆春路46号杭州银行大厦              |                      |
|    |              | 法定代表人：马时雍                         | 联系人：严峻               |
|    |              | 电话：0571-85163127                  | 传真：0571-85179591     |
|    |              | 客服电话：400-888-8508                 | 网址：www.hzbank.com.cn |

|    |            |                        |                    |
|----|------------|------------------------|--------------------|
| 55 | 渤海银行股份有限公司 | 注册地址：天津市河西区马场道201-205号 |                    |
|    |            | 法定代表人：刘宝凤              | 联系人：王宏             |
|    |            | 电话：022-58316666        | 传真：022-58316259    |
|    |            | 客服电话：400-888-8811      | 网址：www.cbhb.com.cn |

（二）注册登记人

| 序号 | 机构名称       | 机构信息                             |                 |
|----|------------|----------------------------------|-----------------|
| 1  | 国泰基金管理有限公司 | 注册地址：上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼   |                 |
|    |            | 办公地址：上海浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼   |                 |
|    |            | 法定代表人：陈勇胜                        | 传真：021-38561800 |
|    |            | 联系人：何晔                           |                 |
|    |            | 客户服务专线：400-888-8688，021-38569000 |                 |

（三）募集成立出具法律意见的律师事务所和经办律师

| 序号 | 机构名称       | 机构信息                            |                 |
|----|------------|---------------------------------|-----------------|
| 1  | 北京市金杜律师事务所 | 注册地址：北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层 |                 |
|    |            | 负责人：王玲                          | 联系人：靳庆军、宋萍萍     |
|    |            | 电话：010-58785588                 | 传真：010-58785599 |
|    |            | 经办律师：靳庆军、宋萍萍                    |                 |

（四）会计师事务所和经办注册会计师

| 序号 | 机构名称             | 机构信息                                 |                 |
|----|------------------|--------------------------------------|-----------------|
| 1  | 普华永道中天会计师事务所有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室 |                 |
|    |                  | 办公地址：上海湖滨路202号普华永道中心11楼              |                 |
|    |                  | 法人代表：杨绍信                             | 联系人：陈宇          |
|    |                  | 电话：021-61238888                      | 传真：021-61238800 |
|    |                  | 经办注册会计师：薛竞、陈宇                        |                 |

## 四、基金名称

国泰货币市场证券投资基金

## 五、基金的类型

契约型开放式

## 六、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。

## 七、投资范围和投资对象

本基金投资于具有良好流动性货币市场工具，主要包括以下：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；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。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

## 八、投资理念

价格终将反映价值，即在市场定价的不均衡中寻求投资收益和组合流动性的均衡。

## 九、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。

## 十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：同期 7 天通知存款利率（税后）。

注：本基金管理人于 2008 年 12 月 29 日在《中国证券报》刊登了《关于变更国泰货币市场证券投资基金业绩比较基准和修改基金合同的公告》，本基金管理人经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案同意后，决定变更本基金的业绩比较基准，同时修改本基金合同的相关内容。

自 2009 年 1 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由原约定的“一年期银行定期储蓄存款

的税后利率[即（1－利息税率）\* 一年期银行定期储蓄存款利率]”，变更为：“同期 7 天通知存款利率（税后）”。

上述业绩比较基准的变更主要是基于本基金定位于现金管理的工具，采用同期 7 天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准，更能体现本基金良好的流动性。

上述变更事项对本基金投资及基金份额持有人利益无不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。

## 十一、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。

## 十二、基金投资组合报告

本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。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于 2010 年 4 月 20 日复核了本投资组合报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止 2010 年 3 月 31 日，本报告所列财务数据未经审计。

### （一）报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 固定收益投资            | 438,415,227.57   | 37.46        |
|    | 其中：债券             | 438,415,227.57   | 37.46        |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 2  | 买入返售金融资产          | —                | —            |
|    | 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      | 718,567,269.47   | 61.39        |
| 4  | 其他资产              | 13,509,305.11    | 1.15         |
| 5  | 合计                | 1,170,491,802.15 | 100.00       |

### （二）报告期债券回购融资情况

| 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 | 0.06 |              |
|    | 其中：买断式回购融资   | —    |              |
| 序号 | 项目           | 金额   | 占基金资产净值比例（%） |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | —    | —            |
|    | 其中：买断式回购融资   | —    | —            |

注：上表中，报告期内债券回购融资余额取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取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。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内无正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

### （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    | 95 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 98 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 33 |

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过 180 天的情况。

#### 2、报告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                 | 42.01              | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 5.99               | —                  |
| 2  | 30 天(含)—60 天           | 8.60               | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 3  | 60 天(含)—90 天           | —                  | —                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | —                  | —                  |
| 4  | 90 天(含)—180 天          | 18.93              | —                  |

|   |                        |       |   |
|---|------------------------|-------|---|
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.72  | - |
| 5 | 180 天(含)—397 天（含）      | 30.01 | - |
|   | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -     | - |
|   | 合计                     | 99.55 | - |

## （四）报告期末按券种品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种                 | 摊余成本（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券                 | -              | -            |
| 2  | 央行票据                 | -              | -            |
| 3  | 金融债券                 | 289,510,044.91 | 24.91        |
|    | 其中：政策性金融债            | 269,527,463.06 | 23.19        |
| 4  | 企业债券                 | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 148,905,182.66 | 12.81        |
| 6  | 其他                   | -              | -            |
| 7  | 合计                   | 438,415,227.57 | 37.72        |
| 8  | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 89,595,901.81  | 7.71         |

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。

## （五）报告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

| 序号 | 债券代码    | 债券名称        | 债券数量(张)   | 摊余成本（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|-------------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 090218  | 09 国开 18    | 1,000,000 | 99,976,285.05 | 8.60         |
| 2  | 090223  | 09 国开 23    | 1,000,000 | 99,937,858.05 | 8.60         |
| 3  | 090213  | 09 国开 13    | 700,000   | 69,613,319.96 | 5.99         |
| 4  | 0981245 | 09 首创集 CP01 | 500,000   | 48,908,885.47 | 4.21         |
| 5  | 0981195 | 09 湘华菱 CP02 | 300,000   | 29,992,630.36 | 2.58         |
| 6  | 0981229 | 09 福耀 CP02  | 200,000   | 20,001,117.16 | 1.72         |
| 7  | 0981263 | 09 陕煤化 CP01 | 200,000   | 20,000,684.65 | 1.72         |
| 8  | 0981175 | 09 湘华菱 CP01 | 200,000   | 20,000,441.85 | 1.72         |

|    |         |            |         |               |      |
|----|---------|------------|---------|---------------|------|
| 9  | 050503  | 05 工行 03   | 200,000 | 19,982,581.85 | 1.72 |
| 10 | 1081072 | 10 金城 CP01 | 100,000 | 10,001,423.17 | 0.86 |

（六）“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 次     |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.2406% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0113% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0917% |

（七）报告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。

（八）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。

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%。

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。

4、其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收利息    | 3,159,453.77  |
| 4  | 应收申购款   | 10,081,167.54 |
| 5  | 其他应收款   | 268,683.80    |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 13,509,305.11 |

### 十三、基金的业绩

基金业绩截止日为 2010 年 12 月 31 日，并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

| 阶段                                      | 基金净值<br>收益率① | 基金净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③      | ②-④     |
|-----------------------------------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 2005 年 6 月 21 日至<br>2005 年 12 月 31 日    | 0.9621%      | 0.0043%             | 0.9567%        | 0%                    | 0.0054%  | 0.0043% |
| 2006 年度                                 | 1.7532%      | 0.0039%             | 1.8799%        | 0.0003%               | -0.1267% | 0.0036% |
| 2007 年度                                 | 3.2968%      | 0.0084%             | 2.7850%        | 0.0019%               | 0.5118%  | 0.0065% |
| 2008 年度                                 | 2.8041%      | 0.0044%             | 3.7621%        | 0.0012%               | -0.9580% | 0.0032% |
| 2009 年度                                 | 1.5294%      | 0.0054%             | 1.3500%        | 0.0000%               | 0.1794%  | 0.0054% |
| 自 2005 年 6 月 21 日<br>至 2009 年 12 月 31 日 | 10.7631%     | 0.0062%             | 10.7338%       | 0.0026%               | 0.0293%  | 0.0036% |

### 十四、基金费用概览

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金投资交易费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- 7、基金销售服务费，具体计提办法按中国证监会的具体规定及基金合同约定执行；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

#### （二）基金费用的费率、计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

（1）费率：年费率 0.33%

（2）计提标准：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33%年费率计提。计算方法如

下：

$$H=E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

（3）计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的基金托管费

（1）费率：年费率 0.10%

（2）计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

（3）计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 3、基金的销售服务费

（1）费率：年费率 0.25%

（2）计提标准：基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

（3）计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人指定的基金销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 4、其他费用

本节第（一）条第 3、4、5、6、8 款约定的费用，根据相关法律法规、基金合同及其他相关合同，按照费用实际支出金额，列入当期基金费用。

### （三）基金费率的调整

基金管理人、基金托管人和基金销售机构可磋商酌情调整基金管理费、托管费和销售服务费费率。调高该费率的，必须符合相关法律法规及基金合同的约定；调低费率的，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于调整后新费率实施日前三个工作日在至少一种指定报刊和网站等媒体刊登公告。

### （四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效之前的费用，包括但不限于律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产列支。国家另有规定的除外。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2010年2月3日刊登的本基金招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了招募说明书内容的截止日期。
- 2、更新了“第三节 基金管理人”的“基金管理人概况”、“基金管理人管理基金的基本情况”、“主要人员情况”、“投资决策委员会成员”等内容。
- 3、更新了“第四节 基金托管人”的“基金托管人基本情况”等相关信息。
- 4、更新了“第五节 相关服务机构”的“基金份额发售机构”和“注册登记人”中的相关信息。
- 5、更新了“第九节 基金的投资”中基金投资组合报告为本基金2010年1季度报告内容。
- 6、更新了“第十节 基金的业绩”，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核；
- 7、更新了“第二十一节 对基金份额持有人的服务”，中的相关信息。
- 8、更新了“第二十二节 其他应披露的事项”，披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文，可登录国泰基金管理有限公司网站[www.gtfund.com](http://www.gtfund.com)。

国泰基金管理有限公司

二〇一〇年八月三日