

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
报告送达日期:二〇一三年八月二十四日

国泰现金管理货币市场基金

2013 年度报告摘要

基金管理人、董事、监事、高级管理人员、基金经理、误性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已公告之日以一月独立董事签字同意，并由基金托管人复核。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据有关法律法规及基金合同的约定，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、投资组合报告等信息，确认复核信息不存在虚假记载、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。

基金合同生效不满半年的，基金管理人可以不编制半年度报告，投资运作情况、投资组合报告等信息的披露、风险提示、投资者适当性分析、风险提示半年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30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
交易代码	02003
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 中国银行股份有限公司
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
下级分类基金的基金简称	国泰现金管理货币 B
下级分类基金的交易代码	020031 020032
报告期末下级分类基金的份额总额	31,596,835.67份 150,382,319.06份

2.2 基金产品说明

在有效控制投资风险和保持较高流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。

1. 整体配置策略

本基金在报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他基金的资产组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金与同类别基金不公开交易和反向输送利润的异常。

2. 分类资产配置策略

本基金在报告期内对资产的流动性分析特征(日均交易量、交易方式、市场流量)、收益水平(到期收益率、利息收入方式、利息收入率、差价收益等)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。

3. 明细资产配置策略

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

4. 4.2 告警信号的确认

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

5. 4.5 买入或卖出证券的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

6. 4.6 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

7. 4.7 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

8. 4.8 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

9. 4.9 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

10. 4.10 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

11. 4.11 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

12. 4.12 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

13. 4.13 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

14. 4.14 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

15. 4.15 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

16. 4.16 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

17. 4.17 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

18. 4.18 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

19. 4.19 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

20. 4.20 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

21. 4.21 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

22. 4.22 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

23. 4.23 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

24. 4.24 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

25. 4.25 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

26. 4.26 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

27. 4.27 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

28. 4.28 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

29. 4.29 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

30. 4.30 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

31. 4.31 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

32. 5.1 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

33. 5.2 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

34. 5.3 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

35. 5.4 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

36. 5.5 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

37. 5.6 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

38. 5.7 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

39. 5.8 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

40. 5.9 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

41. 5.10 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

42. 5.11 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

43. 5.12 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

44. 5.13 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

45. 5.14 买入或卖出金融资产的交易方式

本基金在2013年上半年的国泰现金管理货币 A 债券增强型为151.71%，国泰现金管理货币 B 债券增强型增长率为1.6940%，同期理财产品较基准收益0.6695%。

46.