

国泰6个月短期理财债券型证券投资基金

2013 年 度 报 告 摘 要

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年三月三十一日

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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月25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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或者产生收益。
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。
本基金的财务数据经审计,审计机构为中会计师事务所(特殊普通合伙)为基金出具了无保留意见的审计报告,审计报告日期为2013年12月31日。

2.1 基金基本情况

基金简称	国泰6个月短期理财债券
基金代码	000029
交易代码	000029
基金运作方式	契约封闭式
基金合同生效日	2012年07月26日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	55,980,180.06份
下属分级基金的基金简称	国泰6个月短期理财债券A 国泰6个月短期理财债券B
下属分级基金的基金代码	000029 000030
报告期末下层级基金份额总额	3,423,153.13份 52,557,027.05份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力求本金安全的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	在资产配置上,本基金采取久期匹配和期限分散策略,对投资组合中固定收益类金融资产的期限与基金合同的期限进行期限匹配,主要投资于剩余期限、(或存续期限)不超过基金合同期限的利率债和信用债,并主要投资于信用评级在AA+及以上、期限在一年以内的固定收益类资产。本基金主要投资于银行活期存款、协议存款及大额存单、债券回购和短期融资券等固定收益类资产。本基金在固定收益类资产中,优先选择信用等级较高的品种,并在控制信用风险的前提下,适当配置信用债,以获取较高的收益水平,并控制信用风险。本基金在固定收益类资产中,优先选择信用等级较高的品种,并在控制信用风险的前提下,适当配置信用债,以获取较高的收益水平,并控制信用风险。
投资范围	本基金管理人根据法律法规规定,在符合基金合同约定的前提下,投资于银行活期存款、债券回购、短期融资券、中期票据等信用债,以及符合法律法规规定的固定收益类资产。本基金管理人根据法律法规规定,在符合基金合同约定的前提下,投资于银行活期存款、债券回购、短期融资券、中期票据等信用债,以及符合法律法规规定的固定收益类资产。

业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率×90%+1年期定期存款利率×10%。
风险收益特征	本基金为低风险债券型基金,其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和可转债基金。

2.3 基金管理人、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	中国建设银行股份有限公司
法定代表人	林佳祥	王洪章
信息披露负责人	魏晓燕	张金松
电子邮箱	xmshijia@163.com	tsunajing@ccb.com
客户服务电话	(021) 31089000,400-888-8888	010-67596000
传真	(021-31081800)	010-66215883

2.4 基金信息披露网站

基金管理人网站	http://www.guotai.com.cn
基金托管人网站	http://www.ccb.com.cn

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000

项目	2013年	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日	2012年07月26日至2013年12月31日
1.1期间数据和指标	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券	国泰6个月短期理财债券
本期净收益	16,054,994.57	5,363,437.14	14,542,696.02	13,315,707.42
本期净收益增长率	4.0030%	4.2835%	0.9119%	0.9892%
3.1.2期末数据指标	2013年末	2012年末	2012年末	2012年末
期末基金份额净值	3,423,153.13	52,567,027.05	1,606,605,520.25	133,977,696.21
期末基金份额总额	1,000	1,000	1,000	1,000