

国泰货币市场证券投资基金

[2012] 第一季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一二年四月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金管理人已履行了向农业银行股份有限公司报告的基金合同规定,于2012年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告附录财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:国泰货币

基金主代码:020007

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

报告期基金份额总额:911,404,076.02份

在保持基金安全性、流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的收益。

投资目标:本基金主要为投资者提供流动性管理工具,主要结合短期利率变化、合理安排组合期限和类别比例,在保证本基金安全性、流动性的前提下,获得超过基准的收益。根据对宏观经济指标及趋势的判断,市场预期对于趋势的预期和各类金融工具的流动性特征,决定组合中债券与货币市场的比例。考虑法律法规的限制条件,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组合的类属配置,通过期限配置和收益曲线配置来实现投资目标。

业绩比较基准:定期存款利率(税后)。

本基金属于证券投资基金中的货币型基金,低风险的品种,其预期风险和预期收益都低于股票基金、债券基金和混合型基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 12,376,286.33

2.本期利润 12,376,286.33

3.期初基金份额净值 911,404,076.02

注:本期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(即期价差收益)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。

3.2.1 本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

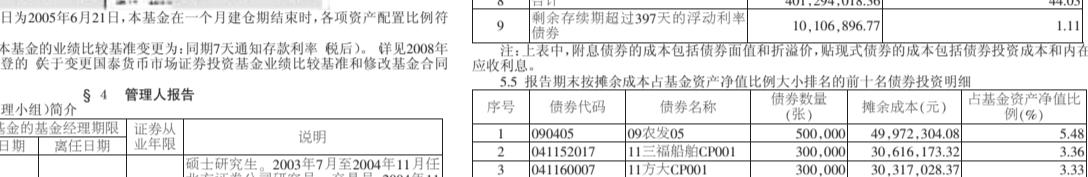
阶段 评估日基金份额净值 评估日基金净值收益率(%) 评估日业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 0.9936% 0.0064% 0.3705% 0.0000% 0.6231% 0.0064%

注:本基金报告期内每份净值均按1.00元计算。

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005年6月21日至2012年3月31日)



注:①本基金合同生效日为2005年6月21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自2009年1月1日起,本基金的业绩比较基准变更为:同期7天通知存款利率(税后)。详见2008年12月29日在《中国证券报》刊登的《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》。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期 说明

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
赵峰	本基金的基金经理,国泰双利债券基金的基金经理	2010-9-18	2012-1-9	硕士研究生,2003年7月至2004年11月任北方信托公司研究员、交易员,2004年11月至2006年10月任国泰证券公司固定收益部业务经理,2006年11月至2008年11月任兴业银行资金营运中心从事债券投资工作,2008年11月任国泰基金管理有限公司基金经理,2010年9月起任国泰双利债券基金经理,2010年9月起担任国泰货币市场证券投资基金的基金经理,2010年9月起担任国泰货币市场证券投资基金的基金经理,2011年6月起担任固定收益总监基金经理。
				1.090405 09/09/05 500,000 49,972,304.08 5.48
				2 041152017 11/三福船舶CP001 300,000 30,616,173.32 3.36
				3 041160007 11/万大CP001 300,000 30,317,028.37 3.33
				4 041253009 12/中逸CP001 300,000 30,046,440.73 3.30
				5 12/2011 12/2011 300,000 29,979,351.50 3.29
				6 041265005 12/和集CP001 200,000 20,198,374.88 2.22
				7 041159008 11/中和科技CP001 200,000 20,000,676.98 2.19
				8 041159024 11/新投CP001 200,000 20,000,584.99 2.19
				9 041164006 11/七师柳沟CP001 200,000 19,989,091.75 2.19
				10 041255003 12/之城CP001 200,000 19,983,906.35 2.19
				5.6 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
				报告期偏离的绝对值在0.25%(含)-0.5%之间的次数 0/次
				报告期偏离的最高值 0.1965%
				报告期偏离的最低值 0.0330%
				报告期偏离的简单平均值 0.1171%
				5.7 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
				5.8 投资组合情况分析
				5.8.1 基金计价方法说明
				5.8.2 报告期内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不超过基金资产净值的2.0%
				5.8.3 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受到公开谴责、处罚的情况
				5.8.4 其他各项资产构成
				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 6,848,811.62
				4 应收申购款 180,012.92
				5 其他应收款 268,683.80
				6 待摊费用 -
				7 其他 -
				8 合计 7,297,508.34
				§ 6 开放式基金份额变动
				单位:份
				本报告期期初基金份额总额 4,780,690,507.43
				本报告期基金份额申购 2,154,393,416.16
				本报告期基金份额赎回 6,023,679,847.57
				本报告期末基金份额总额 911,404,076.02
				§ 7 备查文件目录
				1. 备查文件目录
				2. 国泰金龙货币市场证券投资基金合同
				3. 国泰金龙货币市场证券投资基金托管协议
				4. 报告期内披露的各临时公告
				5. 法律法规要求备查的其他文件
				6. 其他
				7. 备查文件
				8. 其他
				9. 合计
				§ 8 开放式基金份额变动
				序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
				1 国家债券 80,619,825.00 18.81
				2 行业票据 -
				3 金融债券 19,982,000.00 4.66
				4 企业债券 19,982,000.00 4.66
				5 短期融资券 -
				6 中期票据 -
				7 可转债 1,065,268.00 0.25
				8 其他 -
				9 合计 101,667,093.00 23.72
				§ 9 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
				序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
				1 000001 深发展A 1,200,040 18,852,628.40 4.40
				2 020236 大华股份 373,000 17,933,840.00 4.18
				3 600587 新华医疗 615,314 17,690,277.50 4.13
				4 002557 治疗食品 516,950 18,233,243.00 3.22
				5 002327 宝安丽 305,056 13,041,144.00 3.04
				6 002310 东方园林 136,715 14,230,987.50 2.90
				7 000869 张裕A 129,910 12,240,120.20 2.86
				8 300058 蓝色光标 440,080 11,926,168.00 2.78
				9 600036 招商银行 1,000,000 11,000,000.00 2.78
				10 002099 海药药业 607,171 11,439,101.64 2.67
				§ 10 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资明细
				序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
				1 000001 深发展A 1,200,040 18,852,628.40 4.40
				2 020236 大华股份 373,000 17,933,840.00 4.18
				3 600587 新华医疗 615,314 17,690,277.50 4.13
				4 002557 治疗食品 516,950 18,233,243.00 3.22
				5 002327 宝安丽 305,056 13,041,144.00 3.04
				6 002310 东方园林 136,715 14,