

## 国泰货币市场证券投资基金

## [2012]第四季度报告

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:二〇一三年一月十九日

重要提示

基金管理人的董事会及董事声明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、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月16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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金期自2012年10月1日起至2012年12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 约定型开放式

基金合同生效日 2005年6月21日

报告期末基金份额总额 7,854,969,490.62份

投资目标 在保证本金安全和资产流动性最大的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。

投资策略 本基金主要为投资者提供流动风险管理工具，主要包括定期利率变动、合理安排资产组合期限和类型比例，在保证本金安全性的前提下，获取超过基准的较高收益。根据宏观经济长期趋势的变化，适时调整资产组合的期限结构，通过定期利率变动特征，结合货币市场与其他产品的比例变化，考察法律法规的相关规定，根据各属资产的到期收益、税收、相对收益差额及不同属资产的流动性指标等因素决定基金组合的类属配置。通过期限配置和收息率曲线建立合理的资产组合。

业绩比较基准 同期天道通货币利率(税后)。

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。

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

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 19,477,851.53

2.本期利润 19,477,851.53

3.期末基金资产净值 7,854,969,490.62

注:本期已实现收益扣除非经常性损益后的金额为19,477,851.53元。

3.2 本基金当期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰货币市场证券投资基金(2012年6月21日至2012年12月31日)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月21日至2012年12月31日)

注:1.本基金合同生效日为2005年6月21日,本基金在2012年12月31日前,各项资产配比均符合合同约定。2.本基金在2012年12月31日,即报告期末,基金份额净值为1.0000元,基金份额总额为7,854,969,490.62份。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 本基金基金经理小简历

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

胡永青

本基金的基金经理、国泰基金管理有限公司的基金经理

2011-12-5 - 9

硕士研究生,2003年2月至2008年8月在天津保险学院担任固定收益组合经理,2008年8月至2011年8月在信银基金管理担任投资经理,2011年8月加入国泰基金管理有限公司担任双利债券基金经理,2012年1月起担任国泰双利债券基金经理,2012年6月起担任国泰货币基金经理,2012年9月起担任国泰货币基金经理,2013年1月起担任国泰货币基金经理。

胡永青

本基金的基金经理、国泰基金管理有限公司的基金经理

2012-12-3 - 4

硕士研究生,2008年6月至今在天津保险学院担任固定收益组合经理,2012年1月起担任国泰基金管理有限公司担任双利债券基金经理,2012年6月起担任国泰货币基金经理,2012年9月起担任国泰货币基金经理。

姜楠林

本基金的基金经理、国泰基金管理有限公司的基金经理

2012-12-3 - 4

硕士研究生,2008年6月至今在天津保险学院担任固定收益组合经理,2012年1月起担任国泰基金管理有限公司担任双利债券基金经理,2012年6月起担任国泰货币基金经理,2012年9月起担任国泰货币基金经理。

注:1.本基金的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日起,首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。2.本基金的从业年限从行业协会、从业人员资格管理办法的注册时间算起。4.2 公平交易制度的执行情况

4.2.1 公平交易制度的执行情况

4.2.2 不同组合公平交易制度的执行情况

4.2.3 不同基金经理公平交易制度的执行情况

4.2.4 不同投资组合公平交易制度的执行情况

4.2.5 不同基金公平交易制度的执行情况

4.2.6 不同基金经理公平交易制度的执行情况

4.2.7 不同投资组合公平交易制度的执行情况

4.2.8 其他各项产品构成

序号 债券品种 摆余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 209,863,799.05 2.67

2 央行票据 89,881,998.02 1.14

3 金融债券 190,591,153.63 2.43

4 企业债券 190,591,153.63 2.43

5 短期融资券 982,184,913.92 12.50

6 中期票据 60天(含)-90天 2.68

7 其他 10,200.00 0.01

8 合计 1,472,521,864.62 18.71

注:1.本基金的债券投资比例不高于基金资产净值的95%。其中,买入返售金融资产的比例不高于基金资产净值的5%。2.报告期内,本基金未持有股票、权证等权益类证券品种。

3.2.1 本基金当期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

3.2.2 本基金当期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰货币市场证券投资基金(2012年6月21日至2012年12月31日)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月21日至2012年12月31日)

注:1.本基金合同生效日为2005年6月21日,本基金在2012年12月31日前,各项资产配比均符合合同约定。2.本基金在2012年12月31日,即报告期末,基金份额净值为1.0000元,基金份额总额为7,854,969,490.62份。

§ 5 投资组合报告

5.1 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 1,472,521,864.62 18.71

其中:债券 1,472,521,864.62 18.71

资产支持证券 - -

2 买入返售金融资产 3,884,644,741.50 49.36

其中:买断式回购的买入返售金融资产 441,068,216.15 5.60

3 银行存款和结算备金合计 2,477,198,984.55 31.48

4 其他各项资产 35,479,802.48 0.45

5 合计 7,869,845,393.15 100.00

注:报告期末持有的各类资产占基金资产净值比例之和与100%的差异较小。

5.2 报告期内回购向购赎资金情况

序号 项目 占基金资产净值比例(%)

1 报告期内回购向购赎回金额 1.94

其中:买断式回购融资 - -

2 其他 1.94

序号 项目 金额 占基金资产净值的比例(%)

2 报告期末回购向购赎回金额 - -

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

2.1 其他 - -

序号 项目 天数

1 报告期内回购向购赎回期限 57

2 报告期内回购向购赎回金额最高值 134

3 报告期内回购向购赎回金额最低值 57

注:报告期末持有的回购向购赎回金额之和与报告期末持有的回购向购赎回金额之和的差额为57.00元。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产组合情况

序号 项目 占基金资产净值比例(%)

1 平均剩余期限 72.46 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 0.51 -

2 30天(含)-60天 4.07 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

3 60天(含)-90天 2.68 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 0.65 -

4 90天(含)-180天 10.20 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

5 180天(含)-397天(含) 10.32 -

其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 - -

6 其他 1.55 -

注:报告期末持有的回购向购赎回金额之和与报告期末持有的回购向购赎回金额之和的差额为1.55元。

5.4 报告期内按投资品种分类的基金投资组合

序号 报告期内投资品种 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 209,863,799.05 2.67

2 央行票据 89,881,998.02 1.14

3 金融债券 190,591,153.63 2.43

4 企业债券 190,591,153.63 2.43

5 短期融资券 982,184,913.92 12.50

6 中期票据 60天(含)-90天 2.68

7 其他 10,200.00 0.01

注:报告期末持有的回购向购赎回金额之和与报告期末持有的回购向购赎回金额之和的差额为10.20元。

5.5 报告期内回购向购赎回情况

序号 项目 天数

1 报告期内回购向购赎回期限 57

2 报告期内回购向购赎回金额最高值 134

3 报告期内回购向购赎回金额最低值 57

注:报告期末持有的回购向购赎回金额之和与报告期末持有的回购向购赎回金额之和的差额为57.00元。

5.6 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的资产组合情况

序号 项目 占基金资产净值比例(%)

1 平均剩余期限 17.70% 1.33% 19.31% 1.43% -1.61% -0.10%

注:1.此处的平均期限和平均剩余期限是指其与同期业绩比较基准收益率的比较。

3.2.2 基金当期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

3.2.3 基金当期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰货币市场证券投资基金(2012年6月21日至2012年12月31日)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月21日至2012年12月31日)

注:1.本基金合同生效日为2005年6月21日,本基金在2012年12月31日前,各项资产配比均符合合同约定。2.本基金在2012年12月31日,即报告期末,基金份额净值为1.0000元,基金份额总额为7,854,969,490.62份。

§ 6 开放式基金份额变动

报告期(2012年10月1日至2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -4,888,322.63

2.本期利润 78,371,410.63

3.加权平均基金份额本期利润 0.1345

4.期末基金份额净值 527,703,352.22

5.期末基金资产净值 0.9711

注:1.本基金的货币基金指数,风险与收益高于混合基金,债券基金与货币市场的基金,基金指数为混合基金,主要采用完全被动跟踪策略,通过定期调整组合中的资产比例,以期获得与业绩比较基准一致的收益。

2.本基金的货币基金指数,风险与收益低于股票基金、基金指数为股票基金,主要采用完全被动跟踪策略,通过定期调整组合中的资产比例,以期获得与业绩比较基准一致的收益。

3.1 主要财务指标 报告期(2012年10月1日至2012年12月31日)

单位:人民币元