

## 国泰现金管理货币市场基金

## 2015 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：中国银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一六年二月二十八日

§1 重要提示  
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构均不存在虚假记载、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的法律责任。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。  
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月24日复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配计划、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本金不受损失。  
本基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者有了解详细情况，应阅读年度报告正文。  
本报告的财务数据未经审计，普华永道中天 事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意投资风险。  
本报告日期为2016年1月1日起至12月31日止。

## §2 基金简介

基金名称	国泰现金管理货币
基金代码	020001
交易代码	020001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月13日
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
报告期末基金份额总额	2,003,104,160.75份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金基金名称	国泰现金管理货币A 国泰现金管理货币B
下属分级基金基金代码	020001 020002
报告期末下属分级基金的资产总额	229,406,739.11元 1,836,600,421.64元

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	1. 整体资产配置策略 基于对国家宏观政策（财政政策、货币政策等）和短期利率供求状况的判断，合理预期短期利率变化趋势，动态确定投资组合的平均期限期限。 2. 类别资产配置策略 基于对各类资产的流动性特征分析（日均成交量、交易方式、市场流动性）、收益率水平、到期收益率、利息支付方式、利息税务处理、资产配置收益差异等和（利率期限、流动性）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 基于对明细资产的流动性、剩余期限和信用等级分析，根据明细资产的收益率与剩余期限期限，以及流动性指标等优化配置有价证券。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 张勇 电子邮箱 zhangyong@gtfund.com	姓名 张勇 电子邮箱 zhangyong@gtfund.com
客户服务电话	(021) 31089000, 400-888-8888	95566
传真	021-31081800	021-60594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的基金管理人互联网网址 <http://www.gtfund.com>

基金年度报告备置地点 上海市虹口区公平路18号同德大厦16楼-10层

## 3.1 主要会计数据和财务指标

本期已安装收益	9,560,061.57	28,896,921.03	17,841,910.07	138,341,538.14	6,546,563.11	37,394,038.64
本期折旧	9,560,061.57	28,896,921.03	17,841,910.07	138,341,538.14	6,546,563.11	37,394,038.64
本期净收益	3611.14	38599.94	427.77	4.62200	3303.99	418.924

3.1.2.附本数据和基础信息	2015年末		2014年末		2013年末	
	国泰基金资产管理 货币	货币	国泰基金资产管理 货币	货币	国泰基金资产管理 货币	国泰基金资产管理 货币
期末基金资产 净值	228,485,739.11	1,836,606,421.64	374,650,992.91	1,346,364,440.43	440,043,111.46	2,297,771,315.31
期末基金份额 数	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000	1,000