

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:二〇一六年三月二十八日

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、完整性承担个别及连带的法律责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字并同意。

基金托管人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。

基金管理人和基金托管人根据法律法规规定，于2016年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。投资人在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本报告所载的财务资料经审计，华永华德中天师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

| 2.1 基金基本情况        |                   |
|-------------------|-------------------|
| 基金名称              | 国泰现金管理货币          |
| 基金代码              | 0200031           |
| 交易代码              | 0200031           |
| 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        |
| 基金托管人             | 中国银行股份有限公司        |
| 报告期末基金资产净值        | 2,063,104,160.75份 |
| 基金资产净值            | 不适用               |
| 下属分级基金的基金简称       | 国泰现金管理货币A         |
| 下属分级基金的交易代码       | 0200031           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额   | 220,406,730.11份   |
| 1.936,668,421.64份 |                   |

§ 2.2 基金产品说明

投资目标 在有效的控制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. 基本面配置策略  
基于对宏观经济政策(财政政策、货币政策等)和短期资金供求状况的深入研究,合理预期利率变化趋势,动态调整投资组合的平均剩余期限。

2. 类别资产配置策略  
基于对类别资产的流动性特征分析(日均成交量、交易方式、市场容量等),收益水平(到期收益率、利率支付方式、利息支付频率、预期资产收益差等)和风险特征(信用等级、波动率等),动态调整投资组合的类别资产配置比例。

3. 现金资产配置策略  
基于对现金资产的流动性、剩余期限和信用等级的分析,根据现金资产的收益率与剩余期限的匹配,以及流动性和信用等级优化配置各明细资产。

业绩比较基准 七天银行定期存款利率(税后)

风险收益特征 本基金为货币基金,是净值型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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 国泰基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

信息披露负责人 姓名 巴立康 王永民

联系电话 021-31081600转 010-66594896

电子邮箱 xinxiaopu@gtfund.com fec@bankofchina.com

客户服务电话 (021)31089000,400-898-1698 95566

传真 021-31081800

2.4 信息披露方式

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

基金年度报告备置地点 上海市分公司平陆路18号二楼嘉盈大厦16层-19层

基金管理人住所 住所:北京市西城区金融大街20号中国银行总行大厦19层

§ 3 主要数据指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据 2015年 2014年 2013年

期间数据 基金管理费/托管费 国泰现金管理货币 国泰现金管理货币 国泰现金管理货币

和费用 人民币 人民币 人民币 人民币

本期已实现收益 0.946,615.78 28,896,931.03 17,841,916.67 136,341,518.14

6,546,561.11 37,394,038.64

期末基金资产 9,466,615.78 28,896,931.03 17,841,916.67 136,341,518.14

6,546,561.11 37,394,038.64

本期净收益 303,111% 303,090% 4.717% 462.00%

33.94% 4.194%

本期净收益/净值 1,000.00 1,000.00 1,000.00 1,000.00

1,000.00 1,000.00

注:1. 本基金的申购赎回费用按单笔交易金额收取。

2. 本基金定期开放后,本报告期未收入申购、赎回费用,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的金额,本期未计入本期实现收益,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,本期实现收入和本期的利润金额相等。

3.2.1 基金份额净值

3.2.2 基金份额净值变动率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 国泰现金管理货币A:

阶段 阶段 阶段 阶段

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

过去一个月 0.6982% 0.003% 0.6930% 0.103% 0.3479% 0.003%

过去一个月 1.3461% 0.004% 0.8085% 0.000% 0.6666% 0.004%

过去一年 3.6111% 0.007% 1.3600% 0.000% 2.2611% 0.007%

12.3967% 0.006% 4.0600% 0.000% 8.3467% 0.006%

自基金合同生效起 12.5948% 0.0064% 4.1276% 0.000% 8.4673% 0.0064%

至今 12.5948% 0.0064% 4.1276% 0.000% 8.4673% 0.0064%

2. 国泰现金管理货币B:

阶段 阶段 阶段 阶段

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

过去三个月 0.7316% 0.003% 0.3403% 0.000% 0.3013% 0.003%

过去三个月 1.4697% 0.004% 0.6895% 0.000% 0.7892% 0.004%

过去一年 3.8590% 0.007% 1.3600% 0.000% 2.5090% 0.007%

13.2086% 0.006% 4.0600% 0.000% 9.1568% 0.006%

自基金合同生效起 13.4228% 0.0066% 4.1276% 0.000% 8.4673% 0.0066%

3.2.3 基金合同生效以来基金净值收益率及与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰现金管理货币A:

阶段 阶段 阶段 阶段

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

过去三个月 0.7316% 0.003% 0.3403% 0.000% 0.3013% 0.003%

过去三个月 1.4697% 0.004% 0.6895% 0.000% 0.7892% 0.004%

过去一年 3.8590% 0.007% 1.3600% 0.000% 2.5090% 0.007%

13.2086% 0.006% 4.0600% 0.000% 9.1568% 0.006%

自基金合同生效起 13.4228% 0.0066% 4.1276% 0.000% 8.4673% 0.0066%

国泰现金管理货币B:

阶段 阶段 阶段 阶段

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

过去三个月 0.7316% 0.003% 0.3403% 0.000% 0.3013% 0.003%

过去三个月 1.4697% 0.004% 0.6895% 0.000% 0.7892% 0.004%

过去一年 3.8590% 0.007% 1.3600% 0.000% 2.5090% 0.007%

13.2086% 0.006% 4.0600% 0.000% 9.1568% 0.006%

自基金合同生效起 13.4228% 0.0066% 4.1276% 0.000% 8.4673% 0.0066%

注:本基金合同生效日为2012年12月11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. 国泰现金管理货币B:

阶段 阶段 阶段 阶段

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

份额净收益 收益率(%) 收益率(%) 收益率(%)

过去三个月 0.7316% 0.003% 0.3403% 0.000% 0.3013% 0.003%

过去三个月 1.4697% 0.004% 0.6895% 0.000% 0.7892% 0.004%

过去一年 3.8590% 0.007% 1.3600% 0.000% 2.5090% 0.007%

13.2086% 0.006% 4.0600% 0.000% 9.1568% 0.006%

自基金合同生效起 13.4228% 0.0066% 4.1276% 0.000% 8.4673% 0.0066%

注:本基金合同生效日为2012年12月11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。

3.2.4 基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰现金管理货币基金:

累计净值收益率与业绩比较基准收益率走势对比如图

(2012年12月11日至2015年12月31日)

1. 国泰现金管理货币A:

国泰现金管理货币B:

国泰现金管理货币C:

国泰现金管理货币D:

国泰现金管理货币E:

国泰现金管理货币F:

国泰现金管理货币G:

国泰现金管理货币H:

国泰现金管理货币I:

国泰现金管理货币J:

国泰现金管理货币K:

国泰现金管理货币L:

国泰现金管理货币M:

国泰现金管理货币N:

国泰现金管理货币O:

国泰现金管理货币P:

国泰现金管理货币Q:

国泰现金管理货币R:

国泰现金管理货币S:

国泰现金管理货币T:

国泰现金管理货币U:

国泰现金管理货币V:

国泰现金管理货币W:

国泰现金管理货币X:

国泰现金管理货币Y:</p