

国泰货币市场证券投资基金

2017年度报告摘要

信息披露

4.1.2基金管理人(或基金管理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	担任日期	说明
本基金的基金经理	王海峰	2010年9月至2011年9月 任本基金的基金经理 (助理)期间 2011年10月起至2012年12月31日 任本基金的基金经理	任本基金的基金经理 2010年9月至2011年9月 任本基金的基金经理 2011年10月起至2012年12月31日 任本基金的基金经理
本基金的基金经理助理	孙晓峰	2010年9月至2011年9月 任本基金的基金经理助理 2011年10月起至2012年12月31日 任本基金的基金经理助理	任本基金的基金经理助理 2010年9月至2011年9月 任本基金的基金经理助理 2011年10月起至2012年12月31日 任本基金的基金经理助理
本基金的基金经理助理	王海峰	2013年1月起至2017年1月31日 任本基金的基金经理助理	任本基金的基金经理助理 2013年1月起至2017年1月31日 任本基金的基金经理助理
本基金的基金经理助理	孙晓峰	2013年1月起至2017年1月31日 任本基金的基金经理助理	任本基金的基金经理助理 2013年1月起至2017年1月31日 任本基金的基金经理助理

§ 1 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，并由监事会签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司承诺以诚实信用、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。

基金管理人提醒投资者注意基金投资风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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。

本报告的财务资料经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，报告投资者注意阅读。

本基金报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰货币
基金代码	020007
交易代码	020007
契约型开放式	
基金合同生效日	2006年6月21日
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金类型	货币型
报告期末基金份额总额	9,231,115,100.84份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 在保证本金安全和资产流动性最大化的前提下，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性风险管理工具，主要结合短期利率预期、合理安排券种组合比例和久期，在保证本金安全的前提下，通过定期调整资产配置比例、择时操作、适时调整久期、增减持有期限不同的债券品种，以达到在保证本金安全的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。

投资策略 本基金的投资策略从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作的说明

本公司在报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格执行基金投资决策委员会和相关部门对基金经理的授权，确保基金经理在授权范围内履行其职责，严格遵守各投资品种的资产配置比例、投资限制、投资禁止行为、投资禁止事项、投资禁止区域等规定，通过投资决策委员会建立统一的投资指令传达机制。

业绩比较基准 国债回购利率+银行间同业拆借利率+银行间质押式回购利率+银行间国债逆回购利率+银行间同业存款利率+银行间同业定期存款利率。

风险收益特征 本基金属于货币市场基金，是低风险、低波动性的品种，其风险和预期收益率均低于货币基金、债券基金和混合型基金。

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

国泰基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
姓名 李永冰	贾倩
联系电话 021-31016000#0	010-60000009
电子邮箱 xinjiapu@ftfund.com	tgcxpl@abcchina.com
客户服务电话 400-885-0888	96599
传真 021-31018000	010-48121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址 http://www.ftfund.com

基金年度报告发布地点 上海市浦东新区陆家嘴环路1088号国泰金融大厦16层-1608室及住所地任君伟先生办公

§ 3 主要数据和财务指标

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

项目	2017年	2016年	2015年			
本期实现收益总额	629,811,125.03	600,432,339.02	333,591,267.90			
本期利润	629,811,125.03	600,432,339.02	333,591,267.90			
已实现收益	3,920/27	26327%	3,8962%			
3.1.2未分配利润	2017年末	2016年末	2015年末			
末期分红金额	9,231,115,100.84	6,335,341,620.06	21,606,692,071.01			
末期分红比例	1.00%	1.00%	1.00%			
3.2.2基金信息	3.2.2.1基金净值表现	3.2.2.2过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图				
3.2.2.2过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图	注：(1)本基金每个开放日为2006年6月21日，本基金在一个闭合期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。(2)自2006年1月1日起，本基金的业绩比较基准变更为“同期天添盈货币利率(税后)”。(3)详见2006年12月20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)过去五年基金净值增长率数据来源于《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》。					
3.2.3过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图	国泰货币市场证券投资基金					
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图	注：(1)本基金每个开放日为2006年6月21日，本基金在一个闭合期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。(2)自2006年1月1日起，本基金的业绩比较基准变更为“同期天添盈货币利率(税后)”。(3)详见2006年12月20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)过去五年基金净值增长率数据来源于《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》。					
3.3过去三年基金的利润分配情况	单位：人民币元					
阶段	份额净值 收益率 (%)*	每万份收益 值(元)	业绩比较 基准收益 率(%)	标准差 (%)	①-③	②-④
过去三个月	0.9616%	0.0000%	0.343%	0.0000%	0.6113%	0.0000%
过去六个月	1.0172%	0.0007%	0.690%	0.0000%	1.230%	0.0007%
过去一年	3.0702%	0.0007%	1.360%	0.0000%	2.442%	0.0007%
过去二年	4.0526%	0.001%	4.050%	0.0000%	6.626%	0.001%
过去三年	9.7403%	0.0006%	6.760%	0.0000%	12.900%	0.0006%
自基金合同生 效之日起	44.1497%	0.0002%	21,670/3	0.0021%	22.4424%	0.0004%
3.2.2基金净值表现	3.2.2.1基金净值表现	3.2.2.2过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图				
3.2.2.2过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图	注：(1)本基金每个开放日为2006年6月21日，本基金在一个闭合期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。(2)自2006年1月1日起，本基金的业绩比较基准变更为“同期天添盈货币利率(税后)”。(3)详见2006年12月20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)过去五年基金净值增长率数据来源于《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》。					
3.2.3过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图	国泰货币市场证券投资基金					
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图	注：(1)本基金每个开放日为2006年6月21日，本基金在一个闭合期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。(2)自2006年1月1日起，本基金的业绩比较基准变更为“同期天添盈货币利率(税后)”。(3)详见2006年12月20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)过去五年基金净值增长率数据来源于《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》。					
3.3过去三年基金的利润分配情况	单位：人民币元					
年度	已实现收益 形式或现金 分红	直接通过场外 分红	应付利润本年变 动	年度利润分配合 计	备注	
2017	441,710.00	70,915,704.36	17,082,000,997	529,811,175.03	-	
2016	614,029.00	93,368,062/78	-16,904,232/42	600,432,339/02	-	
2015	280,409.40	31,389,167.39	21,773,373.79	333,591,267.90	-	
合计	1,306,240.40	195,702,014/53	21,162,414.04	1,565,814.04	761.65	
§ 4 管理人报告	4.1 基金管理人及基金经理情况	4.1.1基金托管人和基金管理人的基本信息				

国泰基金管理有限公司成立于1993年3月5日，是经中国证监会证监基字[1993]5号文批准成立的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1亿元人民币，公司注册地址为上海，并在北京和深圳设有分公司。

4.1.2基金管理人

4.1.3基金托管人

4.1.4基金销售机构

4.1.5基金评价

4.1.6基金销售服务

4.1.7基金募集

4.1.8基金持续督

4.1.9基金宣传推介

4.1.10基金客户服务

4.1.11基金投诉

4.1.12基金信息披露

4.1.13基金年度报告

4.1.14基金年度报告摘要

4.1.15基金年度报告全文

4.1.16基金年度报告摘要全文

4.1.17基金年度报告摘要全文

4.1.18基金年度报告摘要全文

4.1.19基金年度报告摘要全文

4.1.20基金年度报告摘要全文

4.1.21基金年度报告摘要全文

4.1.22基金年度报告摘要全文

4.1.23基金年度报告摘要全文

4.1.24基金年度报告摘要全文

4.1.25基金年度报告摘要全文

4.1.26基金年度报告摘要全文

4.1.27基金年度报告摘要全文

4.1.28基金年度报告摘要全文

4.1.29基金年度报告摘要全文

4.1.30基金年度报告摘要全文

4.1.31基金年度报告摘要全文

4.1.32基金年度报告摘要全文

4.1.33基金年度报告摘要全文

4.1.34基金年度报告摘要全文

4.1.35基金年度报告摘要全文

4.1.36基金年度报告摘要全文

4.1.37基金年度报告摘要全文

4.1.38基金年度报告摘要全文

4.1.39基金年度报告摘要全文

4.1.40基金年度报告摘要全文

4.1.41基金年度报告摘要全文

4.1.42基金年度报告摘要全文

4.1.43基金年度报告摘要全文

4.1.44基金年度报告摘要全文

4.1.45基金年度报告摘要全文

4.1.46基金年度报告摘要全文