

国泰双利债券证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人: 国泰基金管理有限公司 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
A 农林牧渔 0.00
B 采掘业 0.00
C 制造业 246,598,593.31 14.98
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 1,111,295.51 0.07
E 建筑业 22,310,321.00 1.36
F 交通运输、仓储和邮政业 22,728,290.13 1.38
G 信息技术业 74,887,429.36 4.53
H 批发和零售业 71,304,645.64 4.35
I 房地产业 0.00 0.00
J 金融业 55,587,807.11 3.36
K 综合 22,310,321.00 1.36
L 合计 1,648,000,000.00 100.00

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 000728 国电电力 4,480,000.00 0.27
2 300261 雅化集团 3,411,275.48 0.20
3 002029 安邦护卫 3,289,151.34 0.20
4 000650 格力电器 3,692,550.00 0.22
5 002457 广药集团 2,627,548.22 0.16
6 600478 动力源 806,300.00 0.05
7 002346 振华重工 787,082.13 0.05
8 000826 华鲁恒升 437,129.10 0.03
9 600888 华泰证券 296,714.74 0.02
10 002668 百川股份 295,044.62 0.02

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 110015 国债逆回购 10,382,630.40 0.63
2 央行票据 48,480,000.00 2.95
3 国债期货 159,931,000.00 9.72
4 其中:国债逆回购 1,217,082,076.45 73.94
5 企业中期票据 60,395,000.00 3.67
6 中期票据 216,796,484.02 13.11
7 短期融资券 50,000,000.00 3.00
8 合计 1,712,067,190.87 104.01

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 110015 国债逆回购 1,230,320 131,913,210 8.01
2 118010 11年国债 800,000 84,568,000.00 5.14
3 122779 11年国债 541,740 58,166,623.80 3.53
4 128007 12年中期票据 500,000 52,720,000.00 3.22
5 123135 12年中期票据 500,000 52,720,000.00 3.20

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注
(一)报告期内本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。
(二)基金投资的前十名证券中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库的情况。

9、其他资产构成
序号 类别 金额(元) 占基金资产净值比例(%)
1 存出保证金 129,653.88 0.01
2 应收证券清算款 11,672,361.21 0.72
3 应收股利 0.00 0.00
4 应收利息 30,595,376.06 1.86
5 其他应收款 640,413.84 0.04
6 其他 0.00 0.00
7 预付款项 0.00 0.00
8 待摊费用 0.00 0.00
9 合计 43,200,186.05 2.64

10、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
序号 股票代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 110015 国债逆回购 131,913,210.20 8.01
2 118002 央行票据 90,282,252.30 5.16
3 118001 中期票据 30,908,876.80 1.90
4 125731 央行票据 692,183.72 0.04

11、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

12、基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为: 2012年6月30日,并经基金托管人复核。
本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)国泰双利债券基金
1. 基金管理人: 国泰基金管理有限公司
2. 基金托管人: 中国建设银行股份有限公司

3. 基金名称: 国泰双利债券证券投资基金
4. 基金类型: 债券型证券投资基金

5. 基金的投资目标: 本基金在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下,力争为基金份额持有人谋求较高的当期收入和投资总回报。

6. 基金的投资范围: 本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的国家、金融债、公司债、可转债、可分离债、可转换公司债券、短期融资券、中期票据、央行票据等固定收益类品种,还可投资于一级市场新股申购,持有可转债转股所得的股票、二级市场价格股票、权证等以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

7. 基金的投资策略: 本基金的投资策略包括: 利率策略、信用策略、行业策略、债券选择策略、可转债策略、股票策略、权证策略等。

8. 基金的风险控制: 本基金的风险控制包括: 利率风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险等。

9. 基金的费用: 基金的费用包括: 基金管理费、基金托管费、销售服务费、申购费、赎回费等。

10. 基金的收益分配: 基金收益分配包括: 现金分红、红利再投资等。

11. 基金的信息披露: 基金的信息披露包括: 招募说明书、基金合同、基金定期报告、临时报告等。

12. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

13. 基金的风险揭示: 基金的风险揭示包括: 市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险等。

14. 基金的重要提示: 基金的重要提示包括: 基金管理人承诺、基金托管人承诺等。

15. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

16. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

17. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

18. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

19. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

20. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

21. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

22. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

23. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

24. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

25. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

26. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

27. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

28. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

29. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

30. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

31. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。

32. 基金的其他重要事项: 基金的其他重要事项包括: 基金合同的变更、基金合同的终止等。