

国泰信用互利分级债券型证券投资基金

2013】第二季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

基金管理人的董事会及高级管理人员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责任。

基金托管人和基金管理人保证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责任。

本报告期所载数据截至2013年3月15日，未经审计。报告期末的资产净值、基金份额总额、基金份额净值、投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等指标，均以该日期为基准计算。

本基金经中国证监会2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国泰信用互利分级债券(场内简称:国泰互利)

基金主代码 160217

基金运作方式 级别型开放式

基金合同生效日 2011年12月29日

报告期末基金份额总额 634,288,261.51份

在有效控制投资风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。

1.大类资产配置

本基金将主要根据宏观经济运行周期和国外经济形势的分析和判断,结合国家财政货币政策、证券市场走势、资金面状况、各类资产流动性及其等方面因素,自上而下确定本基金的大类资产配置策略,并通过严格的風險评估,在充分分析市场环境和流动性的基础上,对投资组合进行动态的调整,力求保持基金的总体风险水平相对稳定。

2.债券投资策略

本基金债券投资将根据对经济周期和市场价格的把握,基于对宏观经济的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪,灵活运用久期策略、收益率曲线策略、信用策略、利率策略、回购交易策略等多种投资策略,构建债券投资组合,并根据债券收益率曲线形状变化,动态地对债券投资组合进行调整。

3.新股投资策略

本基金的股票投资过程中新股市操作等一级市场投资。在参与股票一级市场投资的过程中,本基金管理人将全面深入地对企业基本面、发展前景和内在价值,结合市场价格水平,并充分考虑中签率、锁定定期等因素,有效识别风险,防范风险,以获取较好收益。

4.4.1 报告期末本基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 - -

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 948,633,269.92 94.20

其中:债券 948,633,269.92 94.20

4 资产支持证券 - -

5 银行存款品投资 - -

6 买入返售金融资产 - -

7 其他各项资产 25,797,792.18 2.56

8 合计 1,006,990,717.17 100.00

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末本基金资产组合的情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 国家债券 - -

2 央行票据 - -

3 金融债券 - -

其中:政策性金融债 - -

4 企业债券 423,578,569.92 62.22

5 短期融资券 490,817,000.00 72.10

6 中期票据 - -

7 可转债 - -

8 其他 - -

9 合计 948,633,269.92 139.35

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 34,237,700.00 5.03

2 央行票据 - -

3 金融债券 - -

其中:政策性金融债 - -

4 企业债券 423,578,569.92 62.22

5 短期融资券 490,817,000.00 72.10

6 中期票据 - -

7 可转债 - -

8 其他 - -

9 合计 948,633,269.92 139.35

5.3 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(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 11,772,643.42

2.本期利润 7,477,822.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.0100

4.期末基金资产净值 680,779,811.41

5.期末基金份额净值 1.073

§ 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(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 11,772,643.42

2.本期利润 7,477,822.00

3.加权平均基金份额本期利润 0.0100

4.期末基金资产净值 680,779,811.41

5.期末基金份额净值 1.073

§ 4.1 基金经理任职基金经理小组简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

吴魏 国泰信用互利分级债券型证券投资基金基金经理 2011-12-29 -

吴魏 基金经理,国泰龙鼎分级债券型证券投资基金基金经理,国泰债利分级债券型证券投资基金基金经理

4.1.1 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

4.1.2 报告期内,本基金运作严格遵守《基金法》、《证券投资基金法》、《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等法律法规的规定,基金托管人和基金销售机构履行了勤勉尽责的义务,基金资产未出现挪用现象,基金投资运作合法合规,不存在损害基金持有人利益的行为。

4.1.3 报告期内,本基金未发现内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.4 报告期内,本基金未发现不公平对待不同客户、利益输送或利益冲突的情况。

4.1.5 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.6 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.7 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.8 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.9 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.10 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.11 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.12 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.13 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.14 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.15 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.16 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.17 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.18 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.19 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.20 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.21 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.22 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.23 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.24 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.25 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.26 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.27 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.28 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.29 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.30 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.31 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.32 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.33 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.34 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.35 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.36 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.37 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.38 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.39 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.40 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.41 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.42 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.43 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.44 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.45 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.46 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.47 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.48 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.49 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.50 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.51 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.52 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.53 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.54 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.55 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.56 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.57 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.58 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.59 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.60 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.61 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。

4.1.62 报告期内,本基金未发现从事内幕交易、操纵市场的行为或实质性影响证券交易价格的其他行为。

4.1.63 报告期内,本基金未发现从事可能损害基金持有人利益的关联交易行为。