

国泰双利债券证券投资基金

[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:中国银行股份有限公司

报告送达日期:二〇一三年七月十八日

基金管理人的董事会及董事保证本基金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。

基金托管人的董事会及董事保证本基金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。

基金合同由基金管理人和基金托管人订立。

基金合同的任何修改均需经基金份额持有人大会审议批准。

基金合同自2013年4月1日起至2013年6月30日止。

5.2 基金产品概况

基金简称:国泰双利债券证券投资基金

基金代码:020011

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2009年11月11日

报告期末基金份额总额:1,122,011,586.13份

投资目标:通过投资于货币市场等固定收益类资产,在严格控制风险和保持基金资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金主要通过投资于货币市场等固定收益类资产,在严格控制风险和保持基金资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准:99%×沪深300指数收益率+1%×银行存款利率(税后)

风险收益特征:本基金为债券型基金,风险及收益高于货币市场基金,低于股票型基金。

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

下属两级基金的基金简称:国泰双利债券A

下属两级基金的基金代码:020011

报告期末下属两级基金的份额总额:159,288,918.92份

5.3 基金财务报告和基金净值表现

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)

国泰双利债券A 国泰双利债券C

1.本期已实现收益 19,805,033.48 3,422,214.19

2.本期利润 9,331,488.58 978,069.09

3.期末平均基金份额本期利润 0.00900 0.00053

4.期末基金资产净值 1,044,774,322.77 171,840,530.65

5.期末基金份额净值 1.0985 1.079

6.报告期利润 22,667,316.00

7.期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92

8.期末基金资产净值 1,122,011,586.13份

9.期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

10.期末基金资产净值 1,122,011,586.13份

11.期末基金份额净值 1.0985 1.079

12.期末可供分配利润 22,667,316.00

13.期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

14.期末基金份额净值 1.0985 1.079

15.期末可供分配利润 22,667,316.00

16.期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

17.期末基金份额净值 1.0985 1.079

18.报告期利润 22,667,316.00

19.报告期可供分配利润 22,667,316.00

20.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

21.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

22.报告期末基金份额净值 1.0985 1.079

23.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

24.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

25.报告期末基金份额净值 1.0985 1.079

26.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

27.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

28.报告期末基金份额净值 1.0985 1.079

29.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

30.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

31.报告期末基金份额净值 1.0985 1.079

32.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

33.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

34.报告期末基金份额净值 1.0985 1.079

35.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

36.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

37.报告期末基金份额净值 1.0985 1.079

38.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

39.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

40.报告期末基金份额净值 1.0985 1.079

41.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

42.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

43.报告期末基金份额净值 1.0985 1.079

44.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

45.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

46.报告期末基金份额净值 1.0985 1.079

47.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

48.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

49.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

50.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

51.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

52.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

53.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

54.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

55.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

56.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

57.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

58.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

59.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

60.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

61.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

62.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

63.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

64.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

65.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

66.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

67.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

68.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

69.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

70.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

71.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

72.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

73.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

74.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

75.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

76.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

77.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

78.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

79.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

80.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

81.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

82.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

83.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

84.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

85.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

86.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

87.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

88.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

89.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

90.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

91.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

92.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

93.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

94.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

95.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

96.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

97.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

98.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

99.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

100.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

101.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

102.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

103.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

104.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

105.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

106.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

107.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

108.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

109.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

110.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

111.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

112.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

113.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

114.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

115.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

116.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

117.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

118.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

119.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

120.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

121.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

122.报告期末可供分配基金份额利润 159,288,918.92份

123.报告期末可供分配利润 22,667,316.00

124.报告