

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细				金额单位：人民币元
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000559	万向钱潮	29,657,872.18	1.80
2	300166	千红药业	26,248,071.31	2.04
3	600518	康美药业	25,782,008.46	1.77
4	601788	光大证券	20,913,171.43	1.44
5	002368	太极股份	20,722,157.02	1.42
6	002457	青龙药业	19,349,567.57	1.33
7	700999	华润三九	18,658,863.62	1.28
8	300165	天隆国际	18,489,607.77	1.27
9	600011	华能国际	16,825,072.21	1.15
10	300147	香雪制药	16,467,933.53	1.13
11	000197	联环药业	15,983,764.59	1.10
12	600900	重庆钢铁	15,571,016.08	1.07
13	002673	西部矿业	13,400,553.14	0.92
14	000731	四川美丰	11,474,445.95	0.79
15	600837	富春环保	9,770,929.94	0.67
16	002479	富春环保	9,427,752.91	0.65
17	601601	中国太保	8,402,037.07	0.58
18	600572	康恩贝	8,091,540.27	0.56
19	300261	雅本化学	6,300,465.10	0.43
20	002567	唐人神	6,139,220.37	0.42
注：买入金额按买入成交金额（成交申报金额以成交数量 乘以 买入价格）的不考虑相关交易费用。				
7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细				金额单位：人民币元
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300119	瑞普生物	69,395,803.65	4.76
2	300261	雅本化学	69,214,067.89	4.65
3	600518	康美药业	56,248,283.91	3.85
4	002583	海能达	27,080,272.89	1.86
5	300116	康美药业	26,646,215.44	1.74
6	000559	万向钱潮	25,385,113.91	1.64
7	600388	龙净环保	21,121,125.10	1.46
8	601788	光大证券	20,028,835.59	1.37
9	002368	太极股份	19,120,994.59	1.31
10	300165	天隆国际	18,705,686.42	1.28
11	600011	华能国际	17,488,604.32	1.20
12	002457	青龙药业	16,022,978.40	1.09
13	600900	重庆钢铁	14,965,351.08	1.03
14	000731	四川美丰	14,752,069.80	1.01
15	002673	西部矿业	14,119,577.26	0.96
16	002692	西部矿业	12,538,964.45	0.86
17	300147	香雪制药	11,823,771.97	0.78
18	002479	富春环保	10,547,068.18	0.72
19	002400	广生股份	9,840,303.50	0.68
20	600837	富春环保	9,355,655.11	0.64
注：卖出金额按卖出成交金额（成交申报金额以成交数量 乘以 卖出价格）的不考虑相关交易费用。				

买入股票的成本(成交)总额	350,179,446.59
卖出股票的收入(成交)总额	542,074,543.93

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合			金额单位：人民币元
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

2	中央票据	59,287,000.00	4.87
3	金融债券	59,287,000.00	4.87
	其中：政策性金融债	59,287,000.00	4.87

5	企业短期融资券	179,499,000.00	14.75
6	中期票据	-	-
7	可转债	13,909,987.90	1.14
8	其他		

9	合计	1,593,339,792.94	130.97
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细			
		金额单位：人民币元	
			占基金资产

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	中国比例 (%)
1	122776	11新光债	800,000	83,920,000.00	6.90
2	122779	11株城发	541,740	59,320,530.00	4.88
3	122777	11株金茂	2,212,270	241,000,000.00	19.82

4	122616	12黔铁债	500,000	54,250,000.00	4.46
5	122702	12海安债	500,000	53,990,000.00	4.44

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金未报告期末未有资产支持证券投资

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

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策  
本基金本报告期未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

7.10.1 本报告期内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。

7.10.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	264,163.55
2	应收证券清算款	85,651,874.33
2	应收股利	

4	应收利息	39,001,476.04
5	应收申购款	121,025.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	125,038,539.27

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	10,932,000.00	0.90
2	110016	川投转债	2,958,392.00	0.24
3	110007	国投转债	2,822,000.00	0.23

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明					金额单位:人民币元
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产 净值比例	流通受限情况说明

			(%)	
1	000999	华润三九	19,417,392.80	1.60

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

国泰双利债券A	4,652	20,948.12	886,657,298.79	92.10%	76,065,368.42	7.90%
国泰双利债券C	4,317	36,898.06	56,802,654.61	35.66%	102,486,264.31	64.34%
合计	8,969	125,098.85	943,459,953.40	84.09%	178,551,632.73	15.91%

注：本基金机构客户投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的资产；对合计类客户和持有同一基金但持有不同份额类别基金份额的合计类客户，比例的分母采用各自的合计类资产。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况			
项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	国泰双利债券A	0.00	0.00%
	国泰双利债券C	1,428.57	0.00%

合计	1,428.57	0.00%
----	----------	-------

注：国泰双利债券A：本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人、本基金的基金经理及其他基金从业人员未持有本基金。

9 开放式基金份额变动

基金合同生效日 (2009年3月11日)	284,201,131.09	1,696,012,757.95
基金份额总额		
本报告期初基金份额总额	1,203,459,388.51	203,419,807.80
本报告期基金总申购份额	187,823,566	178,949,215.48

减: 平报日期基金总赎回份额	428,360,287.30	223,080,104.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	962,722,667.21	159,288,918.92

10 重大事件揭示

报告期内,本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人重大人事变动如下:

2013年3月6日,本基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》刊登了《国

2013年6月25日,本基金管理人于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登了《国泰基金管理有限责任公司高级管理人员任职公告》,经本基金管理人第五届董事会第二十七次会议审议通过,同意李志坚先生出任公司副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼  
报告期内,本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变  
报告期内,本基金投资策略未发生重大改变。

10.6 报告期内,基金管理人、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况		10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况		金额单位：人民币元
		股票交易	应支付该券商的佣金	备注

券商名称	交易单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	293,731,815.11	32.92%	267,412.57	33.16%	-

招商证券	1	396,322,175.41	67.08%	338,930.61	66.84%	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-

注：基金租用席位的选择标准是：

① 财力雄厚，信誉良好；

② 经营状况良好，各项财务指标符合公司经营理念及宗旨。

6 公司经营行为规范,在最近一年内无重大违规经营行为;

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

长江证券	795,593,102.84	92.50%	48,724,200,000.00	88.68%	-	-
招商证券	64,523,817.02	7.50%	6,217,710,000.00	11.32%	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-