

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  
报告送达日期:二〇一二年三月二十九日

## § 1.1 重要提示

基金份额持有人、董事、监事、高级管理人员、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金销售服务费支付机构、基金评价人、基金投资人应当遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定,并接受监管机关的监督。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金,但不保证基金一定盈利。

基金合同当事人订立本合同时已经阅读并理解了基金合同的内容,同意被基金合同约束。

基金投资人欲了解详细情况,应阅读基金合同。

本基金报告期指截至报告期末的最近一个完整会计年度,即2011年1月1日至2011年12月31日。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	国泰双利债券	
基金主代码	020019	
交易代码	020019	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年3月11日	
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	
报告期期末基金资产总额	1,551,769,362.50元	
基金合同存续期	不定期	
下属基金份额的基金简称	国泰双利债券A	
下属基金份额的交易代码	020019	
报告期末下属分级基金的份额总额	451,270,133.71份	
1,100,499,228.79份		

## 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于债券等固定收益类品种,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长期的当期收入和投资回报。	
投资策略	本基金类型配置通过对未来一段时间股票、债券市场相对收益率的评价,息差策略、利率策略、择时策略等构建固定收益类资产组合。本基金将在新股申购、股票二级市场买卖、债券买卖、回购、货币市场基金买卖等方面通过定期调整、操作类配置、骑乘类配置、骑乘策略,息差策略、利率策略、择时策略等构建固定收益类资产组合。	
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金为债券基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,混合基金,高于货币市场基金。	
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 名称 国泰基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司 姓名 李峰 严东 信息披露负责人 联系电话 021-385616000 010-67595003 电子邮箱 xinxipai@gtfund.com yindong.zhe@cbcm.com 客户服务电话 (021)38569000,400-888-8688 010-67595096 传真 021-3861800 010-66725783	

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a>	
基金管理人住所地	上海市浦东新区陆家嘴环路100号	

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1.1 期间 数据和指 标	2011年		2010年		2009年1月1日至2011年12月31日	
	本期已实现 收益	本期已实现 收益	本期已实现 收益	本期已实现 收益	本期已实现 收益	本期已实现 收益
本期已实现 收益	-117,113.60	-24,077,059.39	34,951,460.15	41,300,869.03	14,363,378.93	712,844.33
本期末基金 总资产	-10,128,034.70	-1,791,261.27	29,594,737.32	30,461,675.82	18,506,044.83	50,817,887.85
加权平均 基金份额 净值	-0.0430	-0.0479	0.0896	0.0865	0.0888	0.0718
本期基金份额 净值增长 率	-4.79%	-5.18%	9.05%	8.43%	10.17%	9.87%
3.1.2 期末未 来可分配 收益	1.000	0.999	1.150	1.140	1.091	1.088

注:1.本期实现收益指基金本期收入减去收入费用后的余额,不含公允价值变动收益;扣除相关费用后的基金本期收入为人民币0.07亿元,扣除上期实现收益后的本期收入为人民币0.07亿元。

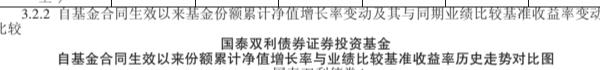
2.本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.1 基金合同生效以来以基金份额累计净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 基金合同生效以来基金每年净值增长率与其同期业绩比较基准收益率的对比



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.1 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



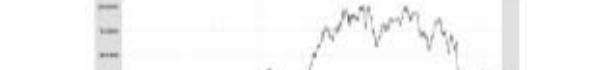
注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.2 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.3 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



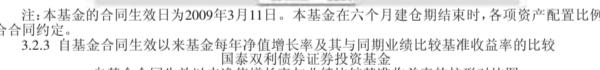
注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.4 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.5 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.6 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.7 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.8 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



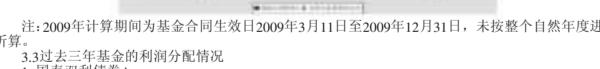
注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.9 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



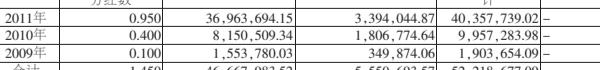
注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.10 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.11 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



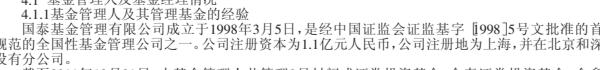
注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.12 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



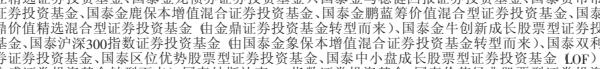
注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.13 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.14 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金的合同生效日为2009年3月11日。本基金在六个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

3.3.15 基金合同生效以来以净资产收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

