国泰信用互利分级债券型证券投资基金之互利A与互利B基金份额上市交易公告书

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2012年1月17日
公告日期:2012年1月12日

一、重要声明与提示

《国泰信用互利分级债券型证券投资基金之互利A与互利B基金份额上市交易公告书》(以下简称"本公告书")依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,国泰信用互利分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")管理人的董事会及董事保证本公告书所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对国泰信用互利分级债券型证券投资基金之互利A与互利B基金份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资人详细查阅刊登在2011年11月21日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站(www.gtfund.com)上公告的《国泰信用互利分级债券型证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1.基金名称:国泰信用互利分级债券型证券投资基金

基金份额名称:信用互利基金份额;场内简称:国泰互利;基金代码:160217

基金份额名称:互利A份额;场内简称:互利A;交易代码:150066

基金份额名称:互利B份额;场内简称:互利B;交易代码:150067

2.基金类型:债券型

3.基金运作方式:契约型开放式

4.基金份额结构:本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额简称"信用互利基金份额",分为场外基础份额和场内基础份额。分级份额包括两类,优先类基金份额(简称"互利A")和进取类基金份额(简称"互利B")。互利A与互利B的基金份额配比始终保持7:3的比例不变。

5.本基金的存续期限为不定期。

6.互利A、互利B与信用互利基金份额的资产合并投资运作。

7.本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资人场外认购所得的份额,将被确认为信用互利基金份额。投资人场内认购所得的份额,将按7:3的基金份额配比自动分拆为互利A和互利B。基金合同生效后,投资人认购所得的信用互利基金份额场内份额的分拆,由基金管理人委托注册登记机构进行,无需基金份额持有人申请。

8.基金合同生效后,本基金信用互利基金份额(基金代码:160217)只可以进行场外申购、赎回及场内申购、赎回,但不上市交易。本基金互利A份额(场内简称:互利A;交易代码:150066)与互利B份额(场内简称:互利B;交易代码:150067)只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。

9.信用互利基金份额的申购与赎回

投资人可通过场外或场内两种方式,申购或赎回信用互利基金份额(基金代码:160217)。

办理信用互利基金份额场内申购、赎回业务的代销机构为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。投资人需使用深圳证券账户,通过深圳证券交易所交易系统办理信用互利基金份额的场内申购、赎回业务。

办理信用互利基金份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外代销机构。投资人需使用开放式基金账户办理信用互利基金份额的场外申购、赎回业务。本基金不对互利A或互利B单独开放场内申购、赎回。

10.份额配对转换

份额配对转换是指本基金场内的信用互利基金份额与互利A、互利B之间的配对转换,包括分拆和合并。分拆指场内的信用互利基金份额按照7:3的基金份额配比分拆成互利A和互利B的行为。合并指互利A和互利B按照7:3的基金份额配比合并成信用互利基金份额场内份额的行为。份额配对转换业务将于2012年1月17日开始办理。

11.基金份额折算

基金份额定期折算的频率为每个会计年度进行1次(可不进行定期折算的除外)。基金份额到点折算的频率为不定期。有关基金份额的定期折算和到点折算约定,参见基金合同第二十章。定期折算日或到点折算日的具体日期,详见基金管理人届时发布的公告。

12.基金份额总额

截至2012年1月9日,本基金的份额总额为539,699,850.85份;其中,信用互利基金份额为469,169,905.85份;互利A份额为49,370,961.00份;互利B份额为21,158,984.00份。

13.基金份额净值

截至2012年1月9日,信用互利基金份额的基金份额净值为1.001元,互利A的基金份额净值为1.002元,互利B的基金份额净值为0.999元。

14.本次上市交易的基金份额简称及交易代码

份额简称:互利A,交易代码:150066

份额简称:互利B,交易代码:150067

15.本次上市交易份额

互利A　49,370,961.00份

互利B　21,158,984.00份

16.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所

17.上市交易日期:2012年1月17日

18.基金管理人:国泰基金管理有限公司

19.基金托管人:中国建设银行股份有限公司

20.本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况

1.本基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证监会证监许可[2011]1706号

2.基金合同生效日:2011年12月29日

3.基金运作方式:契约型开放式

4.基金合同期限:不定期

5.发售日期:2011年12月5日至2011年12月23日

6.发售价格:1.00元人民币

7.发售方式:本基金通过场内、场外两种方式公开发售

8.发售机构

①)场内发售机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位(会员单位名单详见深圳证券交易所网站)。

②)场外发售机构

1)直销机构:国泰基金管理有限公司。

2)代销机构:中国建设银行股份有限公司;中国工商银行股份有限公司;中国农业银行股份有限公司;中国银行股份有限公司;交通银行股份有限公司;招商银行股份有限公司;华夏银行股份有限公司;中信银行股份有限公司;中国民生银行股份有限公司;北京银行股份有限公司;上海农村商业银行股份有限公司;杭州银行股份有限公司;深圳发展银行股份有限公司;中国建银投资证券有限责任公司;国泰君安证券股份有限公司;宏源证券股份有限公司;万联证券有限责任公司;中信建投证券股份有限公司;海通证券股份有限公司;中国银河证券股份有限公司;申银万国证券股份有限公司;东方证券股份有限公司;东吴证券股份有限公司;广发证券股份有限公司;国盛证券有限责任公司;民生证券有限责任公司;上海证券有限责任公司;光大证券股份有限公司;中信万通证券有限责任公司;中信证券股份有限公司;华泰证券股份有限公司;长江证券股份有限公司;渤海证券股份有限公司;中原证券股份有限公司;国信证券股份有限公司;招商证券股份有限公司;兴业证券股份有限公司;齐鲁证券有限公司;安信证券股份有限公司;东莞证券有限责任公司;恒泰证券股份有限公司;厦门证券有限公司;华宝证券有限责任公司;中国国际金融有限公司;华福证券有限责任公司;天相投资顾问有限公司;信达证券股份有限公司;中国民族证券有限责任公司;华龙证券有限责任公司;国元证券股份有限公司;西部证券股份有限公司;平安证券有限责任公司;德邦证券有限责任公司;中航证券有限公司;洛阳银行股份有限公司;方正证券股份有限公司;山西证券股份有限公司;湘财证券有限责任公司;华融证券股份有限公司;日信证券有限责任公司;江海证券有限公司;广州证券有限责任公司;天源证券经纪有限公司。

9.验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

10.认购资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为539,572,600.27元人民币,折合基金份额539,572,600.27份;认购资金在募集期间产生的银行利息共计127,250.58元人民币,折合基金份额127,250.58份,已分别计入各基金份额持有人的基金账户,归各基金份额持有人所有。上述资金总额已于2011年12月29日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户。

根据本基金基金合同的约定,本基金通过场外、场内两种方式公开发售。按照每份基金份额1.00元计算,本基金募集期间募集及利息结转的基金份额共计539,699,850.85份,其中场外认购的基金份额确认为469,169,905.85份;场内认购的基金份额确认为70,529,945.00份。

本次募集有效认购总户数为2,548户。其中,国泰基金管理有限公司的基金从业人员认购本基金的有效认购户数为7户,认购基金份额235,869.15份(含募集期利息结转的份额),占基金总份额比例为0.04%。

11.基金备案情况

本基金于2011年12月29日验资完毕,2011年12月29日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2011年12月29日获得书面确认,本基金基金合同自该日起正式生效。

12.基金合同生效日:2011年12月29日。

13.基金合同生效日的基金份额总额:539,699,850.85份

(二)本基金上市交易的主要内容

1.基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2012]11号

2.上市交易日期:2012年1月17日

3.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资人在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4.上市交易份额简称:互利A、互利B

5.交易代码:互利A为150066、互利B为150067

6.本次上市交易份额:互利A49,370,961.00份;互利B 21,158,984.00份。

7.基金资产净值的披露:每个工作日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的次日公布该日的信用互利基金份额、互利A与互利B的基金份额净值,并在深圳证券交易所行情发布系统进行揭示。

8.未上市交易份额的流通规定:

未上市交易的信用互利基金份额托管在场内,基金份额持有人可选择将信用互利基金份额分拆为互利A和互利B后,即可上市流通。

未上市交易的信用互利基金份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后,选择将信用互利基金份额分拆为互利A和互利B后,即可上市流通。

(三)信用互利基金份额的日常申购、赎回情况

信用互利基金份额的日常申购、赎回业务于2012年1月16日起开始办理,投资人可详细查阅刊登在2012年1月11日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站(www.gtfund.com)上公告的《国泰信用互利分级债券型证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告》。

(四)份额配对转换业务安排

国泰基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定自2012年1月17日起,开通国泰信用互利分级债券型证券投资基金的场内份额配对转换业务,即信用互利基金份额与互利A、互利B之间的配对转换,包括"分拆"和"合并"。基金份额持有人办理份额配对转换业务时,需按招募说明书和相关业务公告中规定的原则进行。

中国证券登记结算有限责任公司会对具备基金份额配对转换业务办理资格的证券公司名单进行更新,投资人可登陆中国证券登记结算有限责任公司网站(www.chinaclear.cn)查询最新名单,本公司对该名单的更新不再另行公告。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

截至2012年1月9日的场内基金份额持有情况:

场内基金份额持有人户数:18户,平均每户持有的场内基金份额:3,918,330份。其中,互利A份额持有人户数:18户,平均每户持有的场内基金份额:2,742,831份;互利B份额持有人户数:18户,平均每户持有的场内基金份额:1,175,499份。

机构投资者持有的本次上市交易的互利A与互利B的基金份额分别为49,002,041份和21,000,875份,分别占本次互利A与互利B上市交易基金份额比例为99.25%和99.25%;个人投资者持有的本次上市交易的互利A与互利B的基金份额分别为368,920份和158,109份,分别占本次互利A与互利B上市交易基金份额比例为0.75%和0.75%。

本次上市交易的互利A与互利B份额前十名持有人情况:

截止日期:2012年1月9日

序号	持有人名称(全称)	持有互利A份额	占互利A份额比(%)	持有互利B份额	占互利B份额比(%)
1	申银万国证券股份有限公司	35,001,458.00	70.89%	15,000,625.00	70.89%
2	招商证券股份有限公司	14,000,583.00	28.36%	6,000,250.00	28.36%
3	邹庆南	70,003.00	0.14%	30,001.00	0.14%
4	李向鸿	70,003.00	0.14%	30,001.00	0.14%
5	万立	63,002.00	0.13%	27,001.00	0.13%
6	张咏晴	57,402.00	0.12%	24,601.00	0.12%
7	潘建勇	35,001.00	0.07%	15,001.00	0.07%
8	张启森	35,001.00	0.07%	15,001.00	0.07%
9	张健宝	21,006.00	0.04%	9,003.00	0.04%
10	陈杨铭	6,302.00	0.01%	2,700.00	0.01%
合计		49,359,761.00	99.98%	21,154,184.00	99.98%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1.基本信息

名称:国泰基金管理有限公司

设立日期:1998年3月5日

住所:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心39楼

法定代表人:陈勇胜

总经理:金旭

注册资本:壹亿壹千万元人民币

设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]5号

工商登记注册的法人营业执照文号:310000000060090

经营范围:基金设立、基金业务管理,及中国证监会批准的其他业务

联系人:何晔

联系电话:021-38561743

股本结构:

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

2.内部组织结构及职能

公司目前下设22个部门和2个分公司,其主要职能如下:

基金管理部:负责权益类公募基金的投资管理工作;

固定收益部:负责固定收益类公募基金的投资和研究工作;

研究开发部:负责公司的投资策略、宏观经济的研究及上市公司的研究和调研等工作;

金融工程部:负责量化投资的研究、基金的风险与绩效分析、提供数量化技术支持等工作;

交易管理部:负责公司所有产品的交易执行、管理和风险控制等相关工作;

财富管理中心:负责企业年金、专户理财和投资咨询业务的市场拓展、投资管理、产品设计、客户服务等相关工作;

基金销售部:负责基金代销机构的业务协调、基金产品的直销和代销业务等工作;

产品规划部:负责产品的基础研究及产品开发、设计、报批等工作;

国际业务部:负责国际业务的发展规划、市场拓展和管理等工作;

营销策划部:负责公司市场营销及产品品牌推广等工作;

客户服务部:负责公司的客户服务等工作;

稽核监察部:负责揭示、控制公司各项业务风险,对公司管理和基金运作合法合规性进行全方位的监察稽核,督促公司内部管理制度的执行,处理日常法律事务、信息披露事务;

运营管理部:负责公司基金和账户的估值核算、资金清算、注册登记、账户管理等工作;

信息技术部:负责公司信息系统的建设和维护等工作;

财务管理部:负责公司财务预决算及成本管理和财务分析等工作;

人力资源部:负责公司人力资源开发与管理工作;

财富大学:负责公司的各类培训工作;

总经理办公室:负责公司战略管理、办公管理及公司品牌建设等工作;

董事会办公室:负责董事会相关工作;

行政管理部:负责公司行政管理及后勤保障等工作;

渠道总部业务管理团队:负责渠道总部的管理维护工作,促进公司市场影响力和销售业绩的提升;

电子商务部(筹备);

北京分公司:负责与当地主管机关及相关单位的联络沟通、所辖区域内基金销售等工作;

深圳分公司:负责与当地主管机关及相关单位的联络沟通以及所辖区域内基金销售工作。

3.人员情况

截至2011年12月31日,本基金管理人共有员工238人,其中126人具有硕士学历,10人具有博士学历。

4.信息披露负责人:李峰

咨询电话:400-888-8688

5.基金管理业务情况

截至2011年12月31日,国泰基金管理有限公司旗下共管理19只开放式基金、3只封闭式基金及多个社保投资组合、企业年金投资组合和特定客户资产管理计划。

6.本基金基金经理

吴晨,硕士研究生,CFA,FRM,9年证券基金从业经历。2001年6月加入国泰基金管理有限公司,历任股票交易员、债券交易员;2004年9月至2005年10月,英国城市大学卡斯商学院金融系学习;2005年10月至2008年3月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理;2008年4月至2009年3月在长信基金管理有限公司从事债券研究;2009年4月至2010年3月在国泰基金管理有限公司任投资经理;2010年4月起担任国泰金龙债券的基金经理;2010年9月起担任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理。

(二)基金托管人

1.基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:张建国(代行)

成立时间:2004年09月17日

组织形式:股份有限公司

注册资本:贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

联系人:尹　东

联系电话:(010)6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身"中国人民建设银行"于1954年成立,1996年易名为"中国建设银行"。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

2.主要经营情况

截至2011年3月31日,中国建设银行资产总额113,125.16亿元,较上年末增加5,021.99亿元,增长4.65%。2011年一季度,中国建设银行实现净利润472.33亿元,较上年同期增长34.23%;年化平均资产回报率1.71%,年化加权平均净资产收益率26.19%;利息净收入716.30亿元,较上年同期增长25.27%;净利差为2.58%,净利息收益率为2.69%,分别较上年同期提高0.28和0.30个百分点;手续费及佣金净收入231.54亿元,较上年同期增长37.29%。其中,结算、理财、电子银行、贷记卡及保理等重点产品快速增长,收入结构日趋合理。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行,在莫斯科设有代表处,设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行,拥有建行亚洲、建银国际,建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机(ATM)39,874台,拥有员工313,867人,为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可,2010年共获得100多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的"全球商业银行品牌十强"列第二位,在"全球银行品牌500强"列第13位,并被评为2010年中国最佳银行;在美国《福布斯》杂志公布的"Interbrand2010年度最佳中国品牌价值排行榜"列第三位,银行业第一位;被《亚洲金融》杂志评为2010年度"中国最佳银行";连续三年被香港《资本》杂志评为"中国杰出零售银行";被中国红十字会总会授予"中国红十字杰出奉献奖章"。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(三)基金验资机构

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司

住所:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法定代表人:杨绍信

电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:单峰

经办注册会计师:汪棣、单峰

六、基金合同摘要

基金合同内容摘要请见附件

七、基金财务状况

本基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产中支付。其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

国泰信用互利分级债券型证券投资基金2012年1月9日资产负债表(未经审计)如下:

国泰信用互利分级债券型证券投资基金

2012年1月9日资产负债表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

资产	本期末2012年1月9日
资产:	
银行存款	4,831,711.12
结算备付金	2,428,636.36
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	532,600,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	473,840.14
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	540,334,187.62
负债与持有人权益	**本期末2012年1月9日**
负债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	113,648.75
应付托管费	32,471.06
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
预提费用	9,000.00
其他负债	7.85
负债合计	155,127.66
所有者权益:	
实收基金	539,699,850.85
未分配利润	479,209.11
所有者权益合计	540,179,059.96
负债和所有者权益总计	540,334,187.62

注:报告截止日2012年1月9日,信用互利基金份额净值1.001元,互利A份额净值:1.002元,互利B份额净值:0.999元;基金份额总额539,699,850.85份,其中信用互利基金份额总额:469,169,905.85份,互利A份额总额:49,370,961.00份,互利B份额总额:21,158,984.00份。

八、基金投资组合

截至2012年1月9日,国泰信用互利分级债券型证券投资基金的投资组合如下:

1.基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	532,600,000.00	98.57
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	7,260,347.48	1.34
6	其他各项资产	473,840.14	0.09
7	合计	540,334,187.62	100.00

2.按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

注:由于四舍五入的原因,公允价值占基金资产净值比例分项之和与合计可能有尾差。

本基金本报告期末持有股票投资。

3.按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

金额单位:人民币元

本基金本报告期末未持有股票投资。

4.按券种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细:

金额单位:人民币元

本基金本报告期末未持有债券投资。

6.按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细:

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.投资组合报告附注

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。

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。

③)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	473,840.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	473,840.14

④)截至2012年1月9日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

⑤)截至2012年1月9日,本基金未持有权证。

九、重大事件揭示

国泰信用互利分级债券型证券投资基金基金合同已于2011年12月29日正式生效,基金管理人于2011年12月30日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及基金管理人网站(www.gtfund.com)上刊登《国泰信用互利分级债券型证券投资基金基金合同生效公告》,于2012年1月6日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《国泰信用互利分级债券型证券投资基金场内认购份额分拆公告》及《关于开通国泰信用互利分级债券型证券投资基金跨系统转托管业务的公告》。

信用互利基金份额的申购、赎回于2012年1月16日起开始办理,投资人可详细查阅刊登在2012年1月11日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及国泰基金管理有限公司网站(www.gtfund.com)上公告的《国泰信用互利分级债券型证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务公告》。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二)根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。

(一)中国证监会核准国泰信用互利分级债券型证券投资基金募集的文件;

(二)《国泰信用互利分级债券型证券投资基金基金合同》;

(三)《国泰信用互利分级债券型证券投资基金招募说明书》;

(四)《国泰信用互利分级债券型证券投资基金托管协议》;

(五)法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照;

(八)中国证监会要求的其他文件。

国泰基金管理有限公司
2012年1月12日

附件　基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

(一)基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利为:

1.自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;

2.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

3.发售基金份额;

4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

5.在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;

6.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

7.在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;

8.在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;

9.自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

10.选择、更换代销机构,并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;

11.选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

12.在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

13.依法召集基金份额持有人大会;

14.法律法规和基金合同规定的其他权利。

(二)基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:

1.依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2.办理基金备案手续;

3.自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7.依法接受基金托管人的监督;

8.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

10.按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

12.编制中期和年度基金报告;

13.严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

14.保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

16.依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

17.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

18.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

19.组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20.因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21.基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

24.执行生效的基金份额持有人大会决议;

25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

26.依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(三)基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的权利为:

1.依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

2.监督基金管理人对本基金的投资运作;

3.自本基金合同生效之日起,依法保管基金资产;

4.在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;

5.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

6.依法召集基金份额持有人大会;

7.按规定取得基金份额持有人名册资料;

8.法律法规和基金合同规定的其他权利。

(四)基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的义务为:

1.安全保管基金财产;

2.设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;

3.对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立;

4.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;

5.保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

6.按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

7.保守基金商业秘密,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

8.对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

9.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

10.按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

11.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

12.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;

13.按照规定监督基金管理人的投资运作;

14.按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

15.依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;

16. 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

17.因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;

19.参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行业监督管理机构,并通知基金管理人;

21.执行生效的基金份额持有人大会决议;

22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

23.建立并保存基金份额持有人名册;

24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(五)基金份额持有人的权利

信用互利基金份额、互利A和互利B仅在其各自份额类别内拥有同等的权益。如果互利A与互利B的运作出现终止,则在终止互利A与互利B的运作后,本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的权利为:

1.分享基金财产收益;

2.参与分配清算后的剩余基金财产;

3.依法转让其持有的互利A与互利B份额,依法申请赎回其持有的信用互利基金份额;

4.按照规定要求召开基金份额持有人大会;

5.出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表