

**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:二〇一五年三月三十日

**1.1 重要提示**  
基金管理人的董事会、董事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法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或者资产增值。  
基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资有风险,投资者在进行投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及相关资料。  
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。  
本报告的财务数据经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。  
本报告自2014年1月1日起至12月31日止。

**2.1 基金基本情况**

基金名称	国泰信用互利分级债券基金 场内简称:国泰信用		
基金代码	160217	场内代码	160217
交易代码	160217		
基金运作方式	契约型开放式		
基金存续期间	2014年12月29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		
国泰基金总部规模	269,030,502.64份		
基金合同生效日期	不定期		
基金份上市证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	互利A	互利B	国泰互利
2014年12月31日	150066	150067	160217
基金份额的基金代码			
期末基金份额总额	2,254,738,000份	966,317,000份	265,809,447.64份

**2.2 基金主要指标**

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。

**2.3 基金管理人及基金托管人**

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	杨中民	田世晖
联系电话	021-31081000/010-65979096	
电子邮箱	stcn@gtfund.com.cn	stn@ccb.com
客户服务电话	021-1880000-400-888-8688	010-65979096
传真	021-31081000	010-66275853

**3.1 主要财务指标和基金净值表现**

项目	2014年	2013年	2012年
本期利润总额	46,035,711.90	42,534,466.57	23,575,204.62
本期净利润	63,566,319.11	26,873,721.41	30,748,577.82
加权平均基金份额本期利润	0.1226	0.0395	0.0886
本期基金份额净值增长率	12.47%	2.94%	7.30%
1.2 期末基金份额净值	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.2154	0.1011	0.0548
期末基金份额净值	314,234,936.50	521,845,983.11	1,038,178,722.05
期末基金份额净值增长率	1.68%	1.07%	1.07%

**3.2 基金净值表现**

自基金合同生效以来基金净值增长率及与业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同于2014年12月29日生效,截至2014年12月31日,本基金在6个月建仓期内,各项资产配置比例符合合同约定。

**3.3 基金净值表现**

自基金合同生效以来基金净值增长率及与业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同于2011年12月29日生效,截至2014年12月31日,本基金在36个月建仓期内,各项资产配置比例符合合同约定。

**4 管理人报告**

**4.1 基金管理人及基金经理简介**

姓名	职务	任职日期	离任日期	年限
吴昊	双聘基金经理	2011-12-29	-	13年

**4.2 基金管理人及基金经理的承诺**

基金管理人及基金经理承诺:严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理人公平交易制度指导意见》等有关法律法规,严格遵守基金合同和托管协议约定,恪守诚信信用、勤勉尽责原则,最大限度保护基金份额持有人的利益,公平对待基金份额持有人,不得从事内幕交易、操纵市场等不正当交易活动,不得利用职务之便为基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构谋取不正当利益,不得进行利益输送。

**4.3 基金管理人及基金经理的承诺**

基金管理人及基金经理承诺:严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理人公平交易制度指导意见》等有关法律法规,严格遵守基金合同和托管协议约定,恪守诚信信用、勤勉尽责原则,最大限度保护基金份额持有人的利益,公平对待基金份额持有人,不得从事内幕交易、操纵市场等不正当交易活动,不得利用职务之便为基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构谋取不正当利益,不得进行利益输送。

**4.4 基金管理人及基金经理的承诺**

基金管理人及基金经理承诺:严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理人公平交易制度指导意见》等有关法律法规,严格遵守基金合同和托管协议约定,恪守诚信信用、勤勉尽责原则,最大限度保护基金份额持有人的利益,公平对待基金份额持有人,不得从事内幕交易、操纵市场等不正当交易活动,不得利用职务之便为基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构谋取不正当利益,不得进行利益输送。

# 国泰信用互利分级债券证券投资基金

## 2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

**2.1 基金基本情况**

基金名称:国泰信用互利分级债券基金 场内简称:国泰信用  
基金代码:160217 场内代码:160217  
交易代码:160217  
基金运作方式:契约型开放式  
基金存续期间:2014年12月29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  
国泰基金总部规模:269,030,502.64份  
基金合同生效日期:不定期  
基金份上市证券交易所:深圳证券交易所  
上市日期:2014年12月31日  
基金份额的基金代码:互利A(150066)、互利B(150067)、国泰互利(160217)  
期末基金份额总额:2,254,738,000份、966,317,000份、265,809,447.64份

**2.2 基金主要指标**

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。

**2.3 基金管理人及基金托管人**

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	杨中民	田世晖
联系电话	021-31081000/010-65979096	
电子邮箱	stcn@gtfund.com.cn	stn@ccb.com
客户服务电话	021-1880000-400-888-8688	010-65979096
传真	021-31081000	010-66275853

**3.1 主要财务指标和基金净值表现**

项目	2014年	2013年	2012年
本期利润总额	46,035,711.90	42,534,466.57	23,575,204.62
本期净利润	63,566,319.11	26,873,721.41	30,748,577.82
加权平均基金份额本期利润	0.1226	0.0395	0.0886
本期基金份额净值增长率	12.47%	2.94%	7.30%
1.2 期末基金份额净值	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.2154	0.1011	0.0548
期末基金份额净值	314,234,936.50	521,845,983.11	1,038,178,722.05
期末基金份额净值增长率	1.68%	1.07%	1.07%

**3.2 基金净值表现**

自基金合同生效以来基金净值增长率及与业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同于2014年12月29日生效,截至2014年12月31日,本基金在6个月建仓期内,各项资产配置比例符合合同约定。

**3.3 基金净值表现**

自基金合同生效以来基金净值增长率及与业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同于2011年12月29日生效,截至2014年12月31日,本基金在36个月建仓期内,各项资产配置比例符合合同约定。

**4 管理人报告**

**4.1 基金管理人及基金经理简介**

姓名	职务	任职日期	离任日期	年限
吴昊	双聘基金经理	2011-12-29	-	13年

**4.2 基金管理人及基金经理的承诺**

基金管理人及基金经理承诺:严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理人公平交易制度指导意见》等有关法律法规,严格遵守基金合同和托管协议约定,恪守诚信信用、勤勉尽责原则,最大限度保护基金份额持有人的利益,公平对待基金份额持有人,不得从事内幕交易、操纵市场等不正当交易活动,不得利用职务之便为基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构谋取不正当利益,不得进行利益输送。

**4.3 基金管理人及基金经理的承诺**

基金管理人及基金经理承诺:严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理人公平交易制度指导意见》等有关法律法规,严格遵守基金合同和托管协议约定,恪守诚信信用、勤勉尽责原则,最大限度保护基金份额持有人的利益,公平对待基金份额持有人,不得从事内幕交易、操纵市场等不正当交易活动,不得利用职务之便为基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构谋取不正当利益,不得进行利益输送。

**4.4 基金管理人及基金经理的承诺**

基金管理人及基金经理承诺:严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理人公平交易制度指导意见》等有关法律法规,严格遵守基金合同和托管协议约定,恪守诚信信用、勤勉尽责原则,最大限度保护基金份额持有人的利益,公平对待基金份额持有人,不得从事内幕交易、操纵市场等不正当交易活动,不得利用职务之便为基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构谋取不正当利益,不得进行利益输送。

**8.2 期末按行业分类的股票投资组合**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.3.2 期末积极投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.4 报告期内权益类资产的重大变动**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.4.1 期末权益类资产重大变动**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.4.2 卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.4.3 买入金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细**

序号	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	18,036,000.00	5.74
2	央行票据	-	-
3	中期票据	-	-
4	企业债/政策性金融债	-	-
5	企业短期融资券	335,691,195.82	106.83
6	中期票据	167,108,000.00	50.98
7	可转债	260,379,004.60	8.39
8	其他	-	-
9	合计	540,294,200.42	171.94

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细**

序号	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041452011	300,000	9.61
2	041456034	200,000	6.39
3	041452052	200,000	6.37
4	121489	200,000	6.36
5	041600097	200,000	6.33

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 期末未兑付公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 本报告期末持有的境外投资组合**

本基金本报告期末未持有境外投资。

**8.12.1 报告期内基金投资组合的重大变动**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.12.2 报告期内基金投资组合的重大变动**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.12.3 报告期内基金投资组合的重大变动**

本基金本报告期末未持有股票。

**9 基金份额持有人信息**

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,464.15
2	应付证券清算款	30,589,238.35
3	应收股利	-
4	应收利息	12,962,192.35
5	应付账款	-
6	其他应付款	4,075.51
7	待转费用	-
8	其他	-
9	合计	43,567,970.36

**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

序号	基金份额	名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中债国债	12,527,200.00	3.99
2	110020	国债	5,584,400.00	1.78

**9.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

序号	持有户数(户)	户持有的基金份额	机构投资者	个人投资者
互利A	199	11,330,334	-	2,254,738.00
互利B	140	6,902,266	-	966,317.00
国泰互利	675	39,791,777	254,298,892.13	95.67%
合计	1,014	265,316,068	254,298,892.13	94.52%

**9.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李润光	175,300.00	7.77%
2	温宇坚	163,357.00	7.25%
3	陈伟坚	110,000.00	4.88%
4	梁翠荣	100,000.00	4.44%
5	郭丽芳	89,796.00	3.98%
6	何佩英	75,400.00	3.34%
7	林耀江	70,000.00	3.10%
8	罗耀华	69,500.00	3.08%
9	罗耀华	66,000.00	2.96%
10	陈宇华	60,000.00	2.66%

**9.4 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	蔡晓峰	89,400.00	9.25%
2	张刚	48,362.00	5.00%
3	周兵	39,900.00	4.13%
4	郭丽芳	38,484.00	3.98%
5	牛秋生	30,000.00	3.10%
6	张海燕	30,000.00	3.10%
7	陈秀英	29,000.00	3.09%
8	张明海	25,819.00	2.67%
9	李俊	23,925.00	2.48%
10	王泽华	21,739.00	2.25%

**9.5 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

项目	基金份额	持有份额(总份数)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利A	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利B	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	合计	96,406.56	0.04%

**9.6 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

项目	基金份额	持有份额(总份数)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利A	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利B	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	合计	96,406.56	0.04%

**9.7 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

项目	基金份额	持有份额(总份数)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利A	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利B	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	合计	96,406.56	0.04%

**9.8 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

项目	基金份额	持有份额(总份数)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利A	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利B	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	合计	96,406.56	0.04%

**9.9 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

项目	基金份额	持有份额(总份数)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利A	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利B	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	合计	96,406.56	0.04%

**9.10 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

项目	基金份额	持有份额(总份数)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利A	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利B	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	合计	96,406.56	0.04%

**9.11 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

项目	基金份额	持有份额(总份数)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利A	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利B	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	合计	96,406.56	0.04%

**9.12 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

项目	基金份额	持有份额(总份数)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利A	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	互利B	0.00	0.00%
基金管理人所有从业人员持有本基金	合计	96,406.56	0.04%