

上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金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:中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、风险收益特征等，复核结果不存在虚假记载、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其资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国泰上证5年期国债ETF
基金主代码 511010
基金运作方式 交易型开放式
基金合同生效日 2013年3月5日
报告期末基金份额总额 13,346,287.00份

投资目标 密紧跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金为指教基金，采用优化抽样复制法。

通过对标的指数中各成份股的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的国债构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，进而达到复制的目标，降低交易成本的。

在正常市况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过0.3%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

本基金主要投资于7-7年期国债，符合目前国债期货推出后，可作为替代现货的工具，投资者未来可以积极利用本基金与国债期货进行套利、套保交易。

§ 3 投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,304,574,235.44	97.10
其中：债券	1,304,574,235.44	97.10	
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	14,000,000.00	1.04
其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	8,097,798.07	0.60
8	其他各项资产	16,852,078.74	1.25
9	合计	1,343,524,112.25	100.00

注：①本基金的预期收益率及风险水平低于股票基金，混合基金，高货币市场基金。本基金属于国债指数基金，是债券基金中投资最低风险的品种。

本基金通过量化抽样复制法，跟踪上证5年期国债指数，其风险收益特征与标的指数所表示的市场的组合的风险收益特征相似。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 17,025,735.78

2.本期利润 22,352,280.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.9775

4.期末基金资产净值 1,342,270,402.39

5.基金份额净值 100.573

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、不含公允价值变动收益；扣除相关费用后的本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

③本基金本期期末未发生赎回，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

④本基金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

⑤本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

⑥本基金本期期末按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

⑦本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产投资明细

⑧本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项投资明细

⑨本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他资产投资明细

⑩本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资组合金融资产投资明细

⑪本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于股票基金的基金资产投资明细

⑫本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于债券基金的基金资产投资明细

⑬本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于货币市场基金的基金资产投资明细

⑭本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于权证的基金资产投资明细

⑮本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于股指期货的基金资产投资明细

⑯本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于国债期货的基金资产投资明细

⑰本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于股票型基金的基金资产投资明细

⑱本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于混合型基金的基金资产投资明细

⑲本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于债券型基金的基金资产投资明细

⑳本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于商品期货、期权的基金资产投资明细

㉑本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于黄金白银的基金资产投资明细

㉒本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于商品基金的基金资产投资明细

㉓本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于商品衍生金融工具的基金资产投资明细

㉔本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于金融衍生品的基金资产投资明细

㉕本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于商品掉期的基金资产投资明细

㉖本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于互换的基金资产投资明细

㉗本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外的基金资产投资明细

㉘本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外上市的基金资产投资明细

㉙本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外交易所的基金资产投资明细

㉚本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外上市的基金资产投资明细

㉛本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外交易所的基金资产投资明细

㉜本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外交易所的基金资产投资明细

㉝本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外交易所的基金资产投资明细

㉞本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外交易所的基金资产投资明细

㉟本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外交易所的基金资产投资明细

㉟本基金本期期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资于境外交易所的基金资产投资明细