上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2014年第一号）

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
重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]11号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

在投资本基金前,投资人应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资人自行负担。

根据基金合同的相关规定,本基金每日可设定申购份额、赎回份额上限,对于超出设定份额上限的申购、赎回申请,基金管理人有权予以拒绝。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金采用优化抽样复制法跟踪标的指数,但由于基金费用、交易成本、组合持仓与标的指数成份券之间存在差异、基金估值方法与指数成份券取价规则之间存在差异等因素,可能造成本基金实际收益率与指数收益率存在偏离。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2014年3月5日,投资组合报告为2013年4季度报告,有关财务数据和净值表现截止日为2013年12月31日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:国泰基金管理有限公司
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:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层
成立时间:1998年3月5日
法定代表人:陈勇胜
注册资本:壹亿壹千万元人民币
联系人:何 晔
联系电话:021-31089000,4008888688
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%

(二)基金管理人管理基金的基本情况

截至2014年3月5日,本基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金:金鑫证券投资基金,以及44只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金(包括2只子基金,分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金)、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金(由金鼎证券投资基金转型而来)、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金(由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来)、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF)(由金盛证券投资基金转型而来)、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金(LOF)、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略股票型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰6个月短期理财债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金(由金泰证券投资基金转型而来)、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF)(由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来)、上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰目标收益保本混合型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金。另外,本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格,目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007年11月19日,本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月14日,本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务(专户理财)的基金公司之一,并于3月24日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者(QDII)资格,成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一,囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

(三)主要人员情况

1.董事会成员

陈勇胜,董事长,硕士研究生,高级经济师,21年证券从业经历。1982年起在中国建设银行总行、中国投资银行总行工作。历任综合计划处、资金处副处长、国际结算部副总经理(主持工作)。1992年起任国泰证券有限公司国际业务部总经理,公司总经理助理兼北京分公司总经理,1998年3月起任国泰基金管理有限公司董事、总经理,1999年10月起任公司董事长、党委书记。

庄屹志,董事,博士研究生,高级经济师。1999年8月至2004年12月在中国建设银行总行工作,历任建设银行总行投资银行部副经理、机构业务部高级经理。2005年1月至2007年7月在中国建银投资有限责任公司任投行部副总兼证券公司董组办公室主任。2007年8月至2009年2月在西南证券有限责任公司任董事、党委委员及副总裁。2009年2月起在中国建银投资有限责任公司工作,先后任资本市场部负责人、战略部负责人,现任中国建银投资有限责任公司办公室(党办、董监办)主任。2012年4月起任公司董事。

林川,董事,博士研究生。2006年6月至2009年1月在美国华盛顿互惠银行任高级计量分析师。2009年2月至2009年7月在美国富升人寿保险任财务经理。2010年3月起在中国建银投资有限责任公司风险管理部工作,现任中国建银投资有限责任公司风险管理部风险管理二组负责人。2012年4月起任公司董事。

Santo Borsellino,董事,硕士研究生。1994-1995年在BANK OF ITALY负责经济研究;1995年在UNIVERSITY OF BOLOGNA任金融部助理,1995-1997年在ROLOFINANCE UNICREDITO ITALIANO GROUP - SOFIPA SpA任金融分析师;1999-2004年在LEHMAN BROTHERS INTERNATIONAL任股票保险研究员;2004-2005年任URWICK CAPITAL LLP合伙人;2005-2006年在CREDIT SUISSE任副总裁;2006-2008年在EURIZONCAPITAL SGR SpA历任研究员/基金经理。2009-2013年任GENERALI INVESTMENTS EUROPE权益部总监。2013年6月起任GENERALI INVESTMENTS EUROPE总经理。2013年11月起任公司董事。

游一冰,董事,大学本科,英国特许保险学会高级会员(FCII)及英国特许保险师(Chartered Insurer)。1989年起任中国人民保险公司总公司营业部助理经理;1994年起任中国保险(欧洲)控股有限公司总裁助理;1996年起任忠利保险有限公司英国分公司再保险承保人;1998年起任忠利亚洲中国地区总经理。2002年起任中意人寿保险有限公司董事。2007年起任中意财产保险有限公司董事、总经理。 2010年6月起任公司董事。

侯文捷,董事,硕士研究生,高级工程师。1994年3月至2002年2月在中国电力信托投资有限公司工作,历任经理部项目经理,证券部项目经理,北京证券营业部副经理,天津证券营业部副经理、经理。2002年2月起在中国电力财务有限公司工作,先后任信息中心主任、信息技术部主任、首席信息师、华北分公司总经理、党组副书记,现任中国电力财务有限公司党组成员、副总经理。2012年4月起任公司董事。

金旭,董事,硕士研究生,20年证券从业经历。1993年7月至2001年11月在中国证监会工作,历任法规处副处长、深圳监管专员办事处机构处副处长、基金监管部综合处处长。2001年11月至2004年7月在华夏基金管理有限公司任副总经理。2004年7月至2006年1月在宝盈基金管理有限公司任总经理。2006年1月至2007年5月在梅隆全球投资有限公司北京代表处任首席代表。2007年5月担任国泰基金管理有限公司总经理。2007年11月起任公司董事。

王军,独立董事,博士研究生,教授。1986年起在对外经济贸易大学法律系、法学院执教,任助教、讲师、副教授、教授、博士生导师、法学院副院长、院长,兼任国务院学位委员会第六届学科评议组法学组成员、全国法律专业学位研究生教育指导委员会委员、国际贸易和金融法律研究所所长、中国法学会国际经济法学研究会副会长、中国法学会民法学研究会常务理事、中国法学教育研究会第一届理事会常务理事、中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、新加坡国际仲裁中心仲裁员、北京仲裁委员会仲裁员、大连仲裁委员会仲裁员等职。2010年6月起任公司独立董事。

刘秉升,独立董事,大学学历,高级经济师。1980年起任吉林省长白县马鹿沟乡党委书记;1982年起任吉林省长白朝鲜族自治县县委常委、常务副县长;1985年起任吉林省抚松县县委常委、常务副县长;1989年起任中国建设银行吉林省白山市支行行长、党委书记;1995年起任中国建设银行长春市分行行长、党委书记;1998年起任中国建设银行海南省分行行长、党委书记。2007年任海南省银行业协会会长。2010年11月起任公司独立董事。

韩少华,独立董事,大学专科,高级会计师。1964年起在中国建设银行河南省工作,历任河南省分行副处长、处长;南阳市分行行长、党组书记;分行总会计师。2003年至2008年任河南省豫财会计师事务所副所长。2010年11月起任公司独立董事。

2.监事会成员

唐建光,监事会主席,大学本科,高级工程师。 1982 年1月至1988年10月在煤炭工业部基建司任工程师;1988年10月至1993年7月在中国统配煤矿总公司基建局任副处长;1993 年7月至1995年9月在中煤建设开发总公司总经理办公室任处长;1995年9月至1998年10月在煤炭部基建管理中心工作,先后任综合处处长、中心副主任;1998年10月至2005年1月在中国建设银行资产保全部任副总经理;2005年1月起在中国建银投资有限责任公司先后任资产管理处置部总经理、企业管理部高级业务总监。2010 年 11 月起任公司监事会主席。

Nikhil Srinivasan,监事,硕士研究生。先后在Allianz SE Singapore, Allianz SE Munich工作,并曾任Allianz SE Munich首席投资官。2013年2月加入意大利忠利集团,担任首席投资官。2013年11月起任公司监事。

刘顺君,监事,硕士研究生,高级经济师。1986年7月至2000年3月在中国人民解放军军事经济学院工作,历任教员、副主任。2000年4月至2003年1月在长江证券有限责任公司工作,历任投资银行总部业务主管、项目经理。2003年1月至2005年5月任长江巴黎百富勤证券有限责任公司北京部高级经理。2005年6月起在中国电力财务有限公司工作,先后任金融租赁公司筹建处综合部主任,营业管理部主任助理,华北分公司总经理助理、华北分公司副总经理、党组成员、纪检组长、工会主席,福建业务部副主任、主任,现任中国电力财务有限公司投资管理部主任。2012年4月起任公司监事。

乔巍,监事,大学本科。1997年1月至2001年7月任职于泰康人寿保险公司,2001年8月至2001年9月任职于上海明诚投资咨询公司,2001年9月至2013年7月任职于华夏基金管理有限公司。2013年8月加入国泰基金管理有限公司,现任公司总经理助理。2013年11月起任公司职工监事。

李辉,监事,大学本科。1997年7月至2000年4月任职于上海远洋运输公司,2000年4月至2002年12月任职于中宏人寿保险有限公司,2003年1月至2005年7月任职于海康人寿保险有限公司,2005年7月至2007年7月任职于AIG集团,2007年7月至2010年3月任职于星展银行。2010年4月加入国泰基金管理有限公司,先后担任财富大学负责人、总经理办公室负责人。现任公司人力资源部及财富大学负责人。2013年11月起任公司职工监事。

束琴,监事,大专学历。1980年3月至1992年3月分别任职于人民银行安康地区分行和工商银行安康地区分行,1993年3月至2008年8月任职于陕西省住房资金管理中心。2008年8月加入国泰基金管理有限公司,先后担任行政管理部主管、总监助理。现任公司行政部副总监。2013年11月起任公司职工监事。

3.高级管理人员

陈勇胜,董事长,简历情况见董事会成员介绍。

金旭,总经理,简历情况见董事会成员介绍。

巴立康,硕士研究生,高级会计师,20年证券基金从业经历。1993年4月至1998年4月在华夏证券工作,历任营业部财务经理、公司计划财务部副总经理兼上海分公司财务部经理。1998年4月至2007年11月在华夏基金管理有限公司工作,历任综合管理部总经理、基金运作部总经理、基金运营总监、稽核总监。2007年12月加入国泰基金管理有限公司,2008年12月起担任公司副总经理。

周向勇,硕士研究生,17年金融从业经历。1996年7月至2004年12月在中国建设银行总行工作,先后任办公室科员、个人银行业务部主任科员。2004年12月至2011年1月在中国建银投资公司工作,任办公室高级业务经理、业务运营组负责人。2011年1月加入国泰基金管理有限公司,任总经理助理,2012年11月起任公司副总经理。

李志坚,硕士研究生,22年金融业从业经历。1992年2月至1994年12月在美国花旗银行台北分行工作,任财务企划助理;1995年 1月至2000年 12月在台湾大华证券公司工作,任债券交易总监;2001年1月至2004年9月在台湾景顺投信股份有限公司工作,负责投资业务;2004年10月至2006年5月在台湾保诚投信股份有限公司工作,负责投资业务;2006年6月至2010年4月在美国纽约人寿台湾子公司工作, 任投资长;2010年5月至2012年12月在台湾富邦投信股份有限公司工作,任投资长;2013年1月起加入国泰基金管理有限公司,任全球投资总监,2013年6月起任公司副总经理。

贺燕萍,硕士,16年证券业从业经历。1998年2月至2007年8月在中信建投证券有限责任公司(原华夏证券有限公司)研究所和机构业务部任总经理助理;2007年8月至2013年8月历任光大证券股份有限公司销售交易部副总经理、总经理和光大证券资产管理有限公司总经理;2013年8月加入国泰基金管理有限公司,2013年10月起任公司副总经理。

林海中,硕士研究生,11年证券基金从业经历。2002年8月至2005年4月在中国证监会信息中心工作,历任专业助理、主任科员;2005年4月至2012年6月在中国证监会基金监管部工作, 历任主任科员、副处长、处长。2012年6月加入国泰基金管理有限公司,2012年8月起任公司督察长。

4.本基金的基金经理

(1)现任基金经理

张一格,硕士研究生,CFA?,7年证券从业经历。2006年6月至2012年8月就职于兴业银行股份有限公司资金营运中心, 任投资经理;2012年8月加入国泰基金管理有限公司,2012年12月起担任国泰民安增利债券型发起式证券投资基金基金经理;2013年3月起兼任上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金及国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理;2013年10月兼任国泰信用债券型证券投资基金的基金经理;2013年12月兼任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)的基金经理;2014年3月兼任国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

(2)历任基金经理

本基金自基金成立以来一直由张一格担任基金经理,无基金经理变更事宜。

5.投资决策委员会成员

本基金管理人设有公司投资决策委员会,其成员在公司总经理、分管副总经理、投资总监、研究开发部、绝对收益投资(事业)部(筹)、权益投资(事业)部(筹)、市场体系等负责人员中产生。公司总经理可以推荐上述人员以外的投资管理相关人员担任成员,督察长和运营体系负责人列席公司投资决策委员会会议。公司投资决策委员会主要职责是根据有关法规和基金合同,审议并决策公司投资研究部门提出的公司整体投资策略、基金大类资产配置原则,以及研究相关投资部门提出的重大投资建议等。

投资决策委员会成员组成如下:

李志坚先生:副总经理
周向勇先生:副总经理
黄焱先生:总经理助理
乔巍先生:总经理助理
张则斌先生:投资总监
张玮先生:投资总监兼研究部开发总监

6.上述人员之间均不存在近亲属或家属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

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:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
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:田青
联系电话:(010) 6759 5096

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)。

截至2013年6月30日,中国建设银行资产总额148,592.14亿元,较上年末增长6.34%。2013年上半年,中国建设银行实现净利润1,199.64亿元,较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%,年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元,较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%,较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%,与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元,较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,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、悉尼、台北设有10家一级海外分行,拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司,海外机构已覆盖到全球14 个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24 小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家,拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2013年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年“世界银行1000强排名”中位列第5,较上年上升1位;在美国《财富》世界500强排名第50位,较上年上升27位;在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2,较上年提升11位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工225人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2013年6月30日,中国建设银行已托管311只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”,在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖,并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖,和墙内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度“最佳基金托管银行”奖。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、申购赎回代理券商

序号	机构名称	机构信息	
1	国泰君安证券股份有限公司	注册地址:上海市浦东新区商城路618号	
		法定代表人:万建华	联系人:芮敏祺
		电话:021-38676161	传真:021-38670161
		客服电话:400-888-8666	网址:www.gtja.com
2	中信建投证券股份有限公司	注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼	
		法定代表人:王常青	联系人:魏明
		电话:010-85130588	传真:010-65182261
		客服电话:400-888-8108	网址:www.csc108.com
3	国信证券股份有限公司	注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼	
		法定代表人:何如	联系人:齐晓燕
		电话:0755-82130833	传真:0755-82133952
		客服电话:95536	网址:www.guosen.com.cn
4	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层	
		法定代表人:宫少林	联系人:林生迎
		电话:0755-82943666	传真:0755-82943636
		网址:www.newone.com.cn	
		客服电话:400-888-8111/95565	
5	中国银河证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座	
		法定代表人:陈有安	联系人:田薇
		电话:010-66568430	传真:010-66568990
		客服电话:400-8888-888	
		网址:www.chinastock.com.cn	
6	海通证券股份有限公司	注册地址:上海市淮海中路98号	
		法定代表人:王开国	联系人:李笑鸣
		电话:021-23219000	传真:021-23219100
		客服电话:400-888-8001(全国),021-95553	
		网址:www.htsec.com	
7	申银万国证券股份有限公司	注册地址:上海市常熟路171号	
		法定代表人:丁国荣	联系人:邓寒冰
		电话:021-54033888	传真:021-54038844
		客服电话:021-962505	网址:www.sw2000.com.cn
8	万联证券有限责任公司	注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层	
		法定代表人:张建军	联系人:罗创斌
		电话:020-38286651	传真:020-22373718-1013
		客服电话:400-888-8133	网址:www.wlzq.com.cn
9	东方证券股份有限公司	注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层	
		法定代表人:潘鑫军	联系人:吴宇
		电话:021-63325888	传真:021-63326173
		客服电话:95503	网址:www.dfzq.com.cn
10	上海证券有限责任公司	注册地址:上海市西藏中路336号	
		法定代表人:邵志民	联系人:张瑾
		电话:021-53519888	传真:021-53519888
		客服电话:021-962518	网址:www.962518.com
11	光大证券股份有限公司	注册地址:上海市静安区新闸路1508号	
		法定代表人:徐浩明	联系人:刘晨
		电话:021-22169999	传真:021-22169134
		客服电话:10108998,400-888-8788	
		网址:www.ebscn.com	
12	宏源证券股份有限公司	注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市文艺路233号	
		法定代表人:冯戎	联系人:李巍
		电话:010-88085858	传真:010-88085195
		客服电话:400-800-0562	网址:www.hysec.com
13	广发证券股份有限公司	注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)	
		办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼	
		法定代表人:孙树明	联系人:黄岚
		电话:020-87555888	传真:020-87555305
		客服电话:95575	网址:www.gf.com.cn
14	中信证券股份有限公司	注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座	
		法定代表人:王东明	联系人:陈忠
		电话:010-84588888	传真:010-84865560
		网址:www.cs.ecitic.com	
15	渤海证券股份有限公司	注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室	
		办公地址:天津市河西区宾水道8号	
		法定代表人:杜庆平	联系人:王兆权
		电话:022-28451861	传真:022-28451892
		客服电话:400-651-5988	网址:www.bhzq.com
16	长江证券股份有限公司	注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦	
		法定代表人:胡运钊	联系人:李良
		电话:027-65799999	传真:027-85481900
		客服电话:95579	网址:www.95579.com
17	中国中投证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元	
		法定代表人:龙增来	联系人:刘毅
		电话:0755-82023442	传真:0755-82026539
		网址:www.china-invs.cn	
		客服电话:400-600-8008,95532	
18	华宝证券有限责任公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层	
		法定代表人:陈林	联系人:刘闻川
		电话:021-68778081	传真021-68778117
		客服电话:400-820-9898	网址:www.cnhbstock.com
19	信达证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	
		法定代表人:高冠江	联系人:唐静
		电话:010-88656100	传真:010-88656290
		客服电话:400-800-8899	网址:www.cindasc.com
序号			
20	国元证券股份有限公司	注册地址:安徽省合肥市寿春路179号	
		法定代表人:凤良志	联系人:祝丽萍
		电话:0551-2257012	传真:0551-2272100
		客服电话:95578	网址:www.gyzq.com.cn
21	德邦证券有限责任公司	注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼	
		法定代表人:姚文平	联系人:罗芳
		电话:021-68761616	传真:021-68767981
		客服电话:4008888128	网址:www.tebon.com.cn
22	中航证券有限公司	注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼	
		法定代表人:杜航	联系人:戴蕾
		电话:0791-86768681	传真:0791-86770178
		客服电话:400-8866-567	网址:www.avicsec.com
23	江海证券有限公司	注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号	
		法定代表人:孙名扬	联系人:张宇宏
		电话:0451-82336863	传真:0451-82287211
		客服电话:400-666-2288	网址:www.jhzq.com.cn
24	西南证券股份有限公司	注册地址:重庆市江北区桥北苑8号	
		法定代表人:余维佳	联系人:张煜
		电话:023-63786141	传真:023-63786212
		网址:http://www.swsc.com.cn	
25	国都证券有限责任公司	注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层	
		法定代表人:常喆	联系人:黄静
		电话:010-84183333	传真:010-84183311-3389
		客服电话:4008188118	网址:www.guodu.com

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构,并及时公告。

(二)登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:中国北京西城区金融大街27号投资广场22层
法定代表人:金颖
联系人:陈龙
电话:(021)58876741
传真:(021)68870311

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号19楼
办公地址:上海市银城中路68号19楼
负责人:韩炯
联系电话:021-31358666
传 真:021-31358600
联系人:黎明
经办律师:吕红、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所: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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:(021)23238888
经办注册会计师:汪棣、魏佳亮
联系人:魏佳亮

四、基金名称

上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金

五、基金类型和存续期限

1.基金类型:债券型
2.基金运作方式:交易型开放式
3.基金的存续期间:不定期

六、投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

七、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份国债和备选成份国债。

为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份国债和备选成份国债的资产比例不低于基金资产净值的90%。

八、投资策略

本基金为指数基金,采用优化抽样复制法。

通过对标的指数中各成份国债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,达到复制标的指数、降低交易成本的目的。

在正常市场情况下,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2%。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了上述范围,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。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即上证5年期国债指数收益率。

如果中证指数有限公司变更或停止上证5年期国债指数的编制及发布,或者上证5年期国债指数被其他指数所替代,或者由于指数编制方法等重大变更导致上证5年期国债指数不宜继续作为本基金的标的指数,或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出,基金管理人依据维护投资人合法权益的原则,经与托管人协商一致,在履行适当程序后有权变更本基金的标的指数并相应地变更业绩比较基准,而无须召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金属于债券基金,其预期收益及风险水平低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。本基金属于国债指数基金,是债券基金中投资风险较低的品种。

本基金采用优化抽样复制策略,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征的市场组合的风险收益特征相似。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及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2014年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截止2013年12月31日。本报告所列财务数据未经审计。

1、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	固定收益投资	835,982,438.65	93.70
	其中:债券	835,982,438.65	93.70
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	32,300,000.00	3.62
	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	5,871,478.53	0.66
6	其他各项资产	17,989,166.99	2.02
7	合计	892,143,084.17	100.00

注:上述债券投资包括可退替代款估值增值。

2、报告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。

3、报告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。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	835,982,438.65	93.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	835,982,438.65	93.76

5、报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019313	13国债13	1,418,370	134,050,148.70	15.03
2	019315	13国债15	1,399,280	131,056,564.80	14.70
3	019303	13国债03	1,054,830	98,710,991.40	11.07
4	019320	13国债20	807,450	78,379,171.50	8.79
5	130015	13附息国债15	800,000	74,928,000.00	8.40

6、报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告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。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金