

信息披露 Disclosure

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

2014 年度报告摘要

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:二〇一五年三月三十一日

1.1 重要提示

基金管理人及基金托管人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约定,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。

本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本金不受损失后能取回的本金不受损失。

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,请仔细阅读年度报告正文。本年度报告正文同时披露在基金管理人网站(www.guotai.com.cn)和中国证监会指定信息披露网站。

本报告财务数据经审计,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2015年1月1日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰上证5年期国债ETF联接
基金简称	026055
交易代码	026055
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月1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
境外基金托管人	33.365,1876.67
下属分级基金名称	国泰上证5年期国债ETF联接A 国泰上证5年期国债ETF联接C
下属分级基金代码	026053 026056
下属分级基金资产总额	21,007,409.72 12,357,777.94

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于目标ETF,跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用ETF联接基金的投资策略,以目标ETF作为主要投资标的,与目标ETF保持跟踪误差在0.2%以内。在正常市场情况下,本基金力争将跟踪误差控制在年化跟踪误差率不超过0.2%,在极端市场情况下,本基金力争将跟踪误差控制在年化跟踪误差率不超过0.5%。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:上证5年期国债指数收益率+0.995%。其中,上证5年期国债指数收益率指上海证券交易所上证5年期国债指数收益率。
风险收益特征	本基金属于债券基金,其预期风险和预期收益水平低于股票基金,高于货币市场基金。本基金的投资范围包括国债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、权证、股指期货、国债期货、股指期货、权证等金融工具,同时本基金还投资于目标ETF,其风险和收益特征与目标ETF相似。

2.3 基金管理人及基金托管人

姓名	职务	任职日期	任期	说明
基金基金经理	王建军	2013-03-01	-	王建军先生,1969年11月19日出生,中国国籍,毕业于上海财经大学,1992年毕业于上海交通大学,1994年毕业于美国康奈尔大学,1998年毕业于美国宾夕法尼亚大学,1999年毕业于美国哈佛大学,2002年毕业于美国哥伦比亚大学,2003年毕业于美国麻省理工学院,2004年毕业于美国哈佛大学,2005年毕业于美国哈佛大学,2006年毕业于美国哈佛大学,2007年毕业于美国哈佛大学,2008年毕业于美国哈佛大学,2009年毕业于美国哈佛大学,2010年毕业于美国哈佛大学,2011年毕业于美国哈佛大学,2012年毕业于美国哈佛大学,2013年毕业于美国哈佛大学,2014年毕业于美国哈佛大学,2015年毕业于美国哈佛大学。

2.4 信息披露方式

基金年度报告备置的地址	http://www.guotai.com.cn
基金年度报告备置的日期	2015年3月31日至2015年4月15日

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2014年	2013年12月31日	2013年12月31日	2013年12月31日
1.1 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较				
本基金期间净值增长率	3.19%	3.19%	3.19%	3.19%
业绩比较基准收益率	3.19%	3.19%	3.19%	3.19%

3.2 基金净值表现

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.3 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.4 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.5 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.6 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.7 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.8 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.9 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.10 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.11 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.12 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.13 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.14 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.15 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.16 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.17 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.18 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.19 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.20 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.21 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.22 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.23 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.24 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.25 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.26 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.27 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.28 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.29 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.30 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.31 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.32 基金业绩分析

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去三个月	2.08%	2.08%	0.00%
过去六个月	2.59%	2.59%	0.00%
过去一年	3.07%	3.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.07%	3.07%	0.00%

3.33 基金业绩分析

||
||
||