

上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金

2018年半年度报告摘要

2018年6月30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
报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

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的法律责任。本半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2018年8月20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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本公司向中财数据资料有限公司提供服务。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| 基金简称 | 上证10年期国债ETF |
|---------------|--------------|
| 基金主代码 | 512300 |
| 基金简称 | 上证10年期国债ETF |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年8月4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 |
| 基金类别 | 债券型 |
| 基金费率 | 见基金合同 |
| 基金资产净值总额 | 506,474.00 |
| 基金合同管理费 | 不适用 |
| 基金资产总值与总资产的差额 | 上证交易所公布 |
| 基金份额净值 | 2017年8月24日 |

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金主要投资于国债，追求到期收益率和回报率的最大化。

投资策略 本基金通过宏观经济分析、选取流动性较好的国债和集合债，对国债的久期和信用级别进行定期调整，达到预期的回报率，降低交易成本的目的。

在正常情况下，本基金的风险水平是适中且低于股票型基金，但高于货币市场基金。本基金将根据宏观经济形势的变化适时调整资产配置比例，从而在不同市场环境下获得较理想的收益。

业绩比较基准 上证国债指数（剔除所有可转换债券）

风险收益特征 债券型基金，具有较低的预期风险和预期收益，适合风险承受能力较低的投资者。

2.3 基金管理人和基金托管人

| 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 |
| 住所 | 上海市徐汇区宛平南路18号 | 北京市东城区建国门内大街16号 |
| 法定代表人 | 孙树明 | 田国立 |
| 客户服务电话 | 021-31081800 | 010-65560006 |
| 电子邮箱 | xinxip@fund.com | tianqih@cb.com |
| 客户服务电话 | 021-31081800, 400-888-8888 | 010-67595006 |
| 传真 | 021-31081800 | 010-66756533 |

2.4 信息披露方式

基金管理人半年度报告的网址 www.gtfund.com

基金管理人半年度报告的地点 上海市虹桥公司路18号国泰基金大厦16层-19层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1 本期数据和指标 | | 报告期：2018年1月1日至2018年6月30日 |
|--------------|--|--------------------------|
| 本期已实现收益 | | 640,980.90 |
| 本期利润 | | 2,317,386.55 |
| 加权平均基金份额本期利润 | | 4.3652 |
| 期末基金资产净值 | | 453% |

| 3.2 累计数据和指标 | | 报告期：2018年6月30日 |
|-------------|--|----------------|
| 基金份额总额 | | 1,980 |
| 基金份额净值 | | 52,119,689.00 |
| 基金份额总资产 | | 52,119,689.00 |

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)扣除相关费用后的余额，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)所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，费用影响会导致基金份额净值下跌。

(3)本基金于2017年8月4日进行了基金份额折算，折算比例

为0.01。

(4)本基金合同生效日为2017年8月4日，截止报告期末，本基金运作尚不满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

| 阶段 | 份额净值增长率为 | 业绩比较基准收益率 | 差额百分比 | ①-② | ②-④ |
|-------|----------|-----------|-------|-------|--------|
| 过去一个月 | 1.18% | 0.18% | 0.02% | 0.10% | 0.28% |
| 过去三个月 | 2.65% | 0.23% | 2.94% | 0.14% | -0.29% |
| 过去六个月 | 4.55% | 0.18% | 4.87% | 0.11% | -0.34% |
| 过去一年 | 2.91% | 0.15% | 3.81% | 0.11% | -0.80% |

注：2.自基金合同生效以来以基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的差额百分比。

注：2.自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的差额百分比。

注：2.自基金合同生效以来份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额百分比。

注：2.自基金合同生效以来份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额百分比。