

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
报告送达日期:二〇一四年三月三十一日

基金持有人的基金份额,基金份额持有人不得存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并承担对内真实的、准确性、完整性承担个别及连带的法律责任。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。

基金托管人中行建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定,于2014年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置比例、风险收益特征、投资组合报告等内容,保证复核后不存在虚假记载、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本基金,但不保证本基金一定盈利。

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当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要除年度报告正文外,投资者欲了解详细情况,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,投资者注意阅读。

本报告期自2013年3月7日(基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

§ 2 基金简介

基金简称:国泰上证5年期国债ETF联接基金

基金代码:620035

交易场所:交易所

基金运作方式:契约型开放式

基金的首次日起:2013年3月7日

基金托管人:国泰基金管理有限公司

基金销售机构:中行建设银行股份有限公司

报告期末基金资产总额:249,275.49亿元

下属基金份额的基金简称:国泰上证5年期国债ETF联接A

基金代码:620035

报告期末基金份额净值:0.9206

下属基金份额的基金总份额:128,581,070,37份

报告期末基金份额净值:120,694,078.73份

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

基金代码:620035

基金运作方式:契约型开放式

基金的首次日起:2013年3月7日

基金托管人:国泰基金管理有限公司

基金销售机构:中行建设银行股份有限公司

报告期末基金资产总额:249,275.49亿元

下属基金份额的基金简称:国泰上证5年期国债ETF联接C

基金代码:620036

报告期末基金份额净值:0.9206

下属基金份额的基金总份额:128,581,070,37份

报告期末基金份额净值:120,694,078.73份

2.2 基金产品说明

投资目标:通过主要投资于ETF,紧密跟踪指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金主要投资于ETF,以ETF作为主要投资标的,方便投资者的客户群通过

本基金投资目标:本基金主要投资于ETF,以ETF作为主要投资标的,本基金将

本基金投资于国债,以国债为主要投资标的,本基金将

本基金投资于国债,以国债为主要投资标的,本基金将