上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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:二〇一九年七月十八日

§1 重要提示

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约定,于2019年7月16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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019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
交易代码	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	3,736,287.00份
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。
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。
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。
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。
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

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	2,222,897.10
2.本期利润	600,405.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.1646
4.期末基金资产净值	437,962,745.62
5.期末基金份额净值	117.219

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3)本基金于2013年3月5日进行了基金份额折算,折算比例为0.01。期末还原后基金份额累计净值=(期末基金份额净值+基金份额累计分红金额)×折算比例,该净值可反映投资者在认购期以份额面值1.00元购买国债ETF后的实际份额净值变动情况。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告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

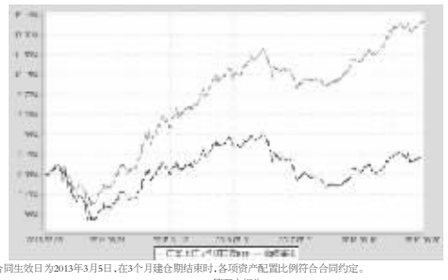
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.20%	0.09%	-0.38%	0.08%	0.58%	0.01%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年3月5日至2019年6月30日)



注:本基金合同生效日为2013年3月5日,在3个月建仓期结束时,各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩哲昊	本基金的基金经理	2015-06-25	2019-07-09	9年	硕士,2010年9月至2011年9月在受雇投资有限公司工作,任交易员,2011年9月加入国泰基金管理有限公司,历任债券交易员、基金经理助理,2015年6月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金的基金经理,2015年6月至2019年7月任上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2015年6月至2018年10月任国泰上证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,2015年6月至2017年3月任国泰创利债券型证券投资基金的基金经理,2015年7月至2017年3月任国泰海金互联网债券型证券投资基金的基金经理,2015年7月至2017年8月任国泰利息宝货币市场基金的基金经理,2016年12月起兼任国泰利是宝货币市场基金的基金经理,2017年2月至2018年4月任国泰润利纯债债券型证券投资基金的基金经理,2017年3月起兼任国泰润泰纯债债券型证券投资基金的基金经理,2017年7月至2018年11月任国泰润鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理,2017年8月至2018年11月任国泰瑞利交易型货币市场基金和上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2017年12月至2018年6月任国泰民润纯债债券型证券投资基金和国泰润芙纯债债券型证券投资基金的基金经理。
艾小军	本基金的基金经理,国泰上证180金融ETF联接、国泰上证180金融ETF、国泰深证TMT50指数分级、国泰沪深300指数、国泰黄金ETF、国泰中证军工ETF、国泰中证全指证券公司ETF、国泰国证航天军工指数(LOF)、国泰中证申万证券行业指数(LOF)、国泰策略价值灵活配置混合、国泰量化成长优选混合、国泰黄金ETF联接、国泰沪深300指数增强、国泰CES半导体行业ETF、国泰中证500指数增强、上证5年期国债ETF、国泰中证500指数增强(LOF)、国泰沪深300指数增强(LOF)、国泰CES半导体行业指数增强(LOF)