

国泰纳斯达克100指数证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2024年5月30日

送出日期：2024年6月13日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|--|----------------|---|
| 基金简称 | 国泰纳斯达克 100 指数 (QDII) | 基金代码 | 160213 |
| 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 |
| 境外投资顾问 | - | 境外托管人 | 美国道富银行 State Street Bank and Trust Company |
| 基金合同生效日 | 2010-04-29 | | |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 朱丹 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022-01-27 |
| | | 证券从业日期 | 2016-01-11 |
| 其他 | 基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时向中国证监会报告，说明出现上述情况的原因并提出解决方案。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见本基金招募说明书（更新）“四、基金的投资”。

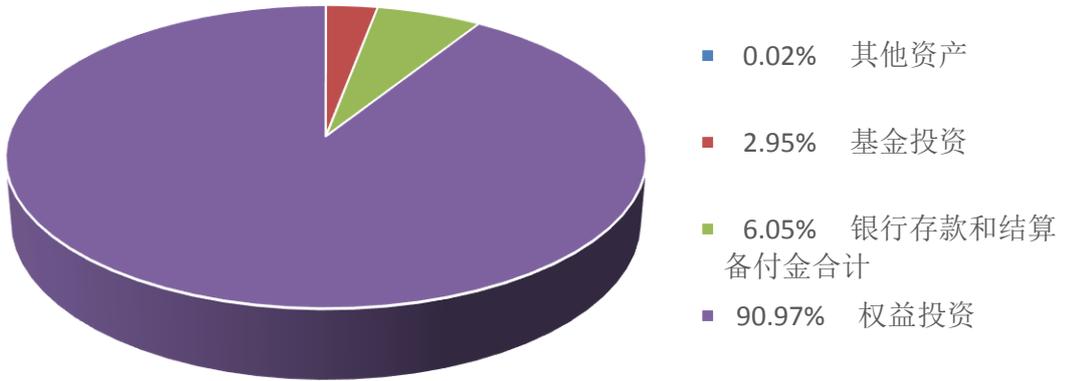
| | |
|------|--|
| 投资目标 | 通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现本基金对纳斯达克100 指数 (Nasdaq-100 Index,以下简称“标的指数”) 的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。 |
| 投资范围 | 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括Nasdaq-100指数成份股、在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的、以Nasdaq-100指数为投资标的的指数型公募基金（包括ETF）（以下简称“目标基金”）、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。 本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%(若法律法规变更或取消本限制的，则本基金按变更或取 |

| | |
|---------------|---|
| | <p>消后的规定执行), 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等; 本基金至少80%的资产投资于Nasdaq-100指数的成份股和目标基金, 其中, 本基金持有的目标基金的市值合计不超过本基金资产净值的10%。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的标的指数为纳斯达克100指数(Nasdaq-100 Index) 及其未来可能发生的变更。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金原则上采取完全复制策略, 即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况导致基金无法及时获得足够数量的股票时, 基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合, 追求尽可能贴近目标指数的表现。</p> <p>本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差不超过0.5%, 年跟踪误差不超过5% (注: 以美元资产计价计算)。</p> <p>开放式指数基金跟踪误差的来源主要包括现金拖累、成份股调整时的交易策略以及基金每日现金流入/流出的建仓/变现策略、成份股股息的再投资策略等。基金管理人将通过对这些因素的有效管理, 追求跟踪误差最小化。</p> <p>另外, 本基金基于流动性管理的需要, 将投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略、且以Nasdaq-100指数为投资标的的指数型公募基金(包括ETF)(以下简称“目标基金”)。同时, 为更好地实现本基金的投资目标, 本基金还将在条件允许的情况下, 开展证券借贷业务以及投资于股指期货等金融衍生品, 以期降低跟踪误差水平。本基金投资于金融衍生品的目标是替代跟踪标的指数的成份股, 使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。不得应用于投机交易目的, 或用作杠杆工具放大基金的投资。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>纳斯达克100指数(Nasdaq-100 Index)收益率(总收益指数收益率)</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金, 预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金, 跟踪标的指数市场表现, 目标为获取市场平均收益, 是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。</p> |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

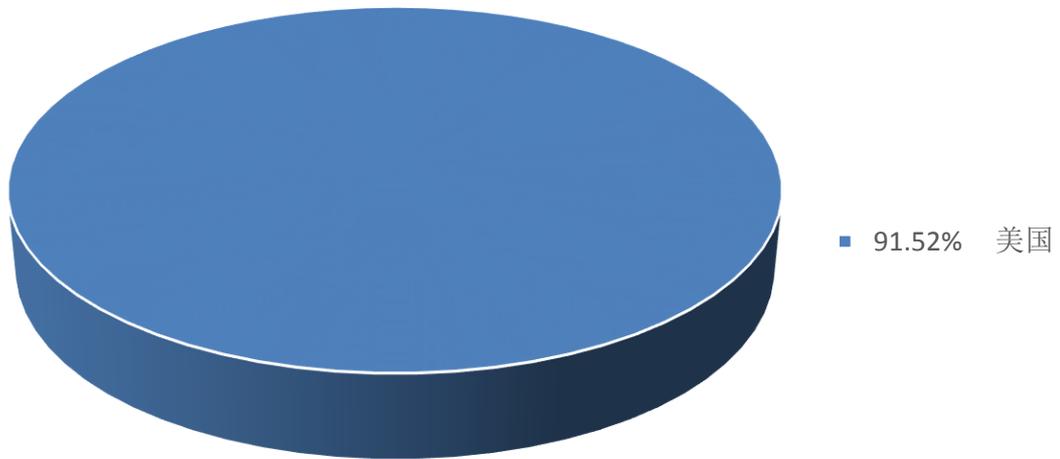
投资组合资产配置图表

数据截止日期：2024-03-31

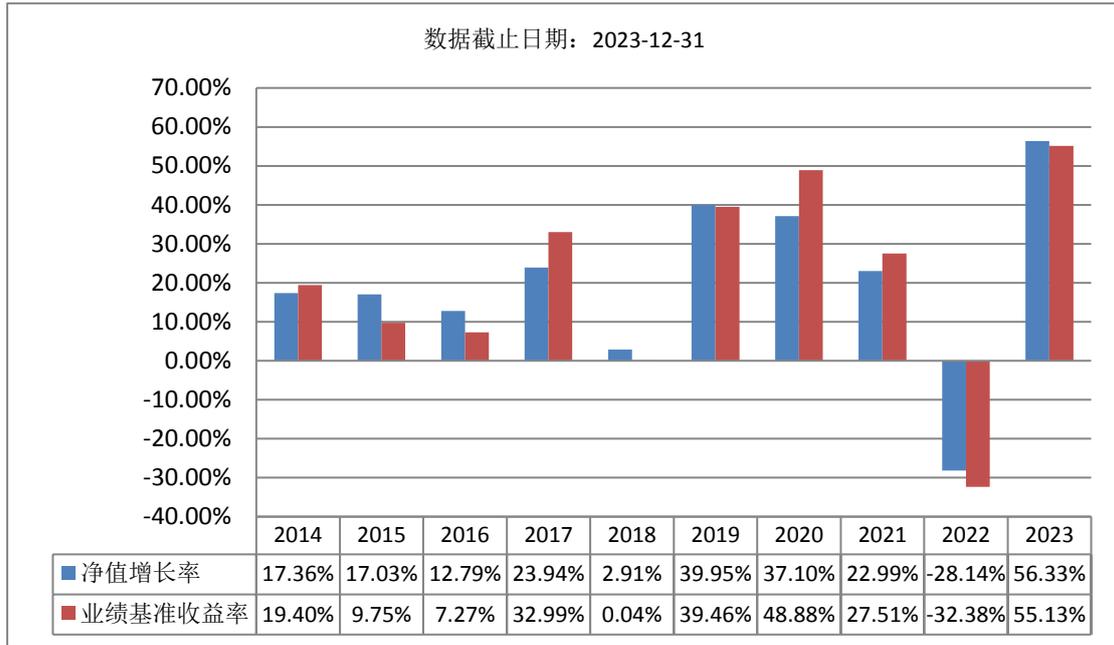


区域配置图表

数据截止日期：2024-03-31



(三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|-----------|-----------------------------|------------|----|
| 申购费 (前收费) | M < 50 万元 | 1.50% | |
| | 50 万元 ≤ M < 200 万元 | 1.20% | |
| | 200 万元 ≤ M < 500 万元 | 0.80% | |
| | M ≥ 500 万元 | 1000 元 / 笔 | |
| 赎回费 | N < 7 天 | 1.50% | |
| | 7 天 ≤ N < 365 天 | 0.50% | |
| | 365 天 ≤ N < 730 天 | 0.25% | |
| | N ≥ 730 天 | 0.00% | |

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 (元) | 收取方 |
|------|--------------------|------------|
| 管理费 | 0.80% | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费 | 0.25% | 基金托管人 |
| 审计费用 | 100,000.00 | 会计师事务所 |

| | | |
|---------|----------------------------------|--------|
| 信息披露费 | 120,000.00 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | 0.06% | 指数编制公司 |
| 其他费用 | 其他按照国家有关规定和《基金合同》约定可以在基金财产中列支的费用 | 相关服务机构 |

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。
2、上表中年费用金额为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 1.12% |

注：基金管理费率、托管费率为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的招募说明书（更新）等销售文件。

本基金面临的风险主要有境外投资产品风险、开放式基金风险（包括利率风险、流动性风险、信用风险、跟踪误差风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、操作或技术风险、会计核算风险、税务风险、衍生品风险等）及法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评级可能不一致的风险等。

本基金境外投资产品风险：

（1）海外市场风险

市场风险是指由于市场因素如基础利率、汇率、股票价格和商品价格的变化或由于这些市场因素的波动率的变化而引起的证券价格的非预期变化，并产生损失的可能性。

由于本基金将投资于海外股票市场，因此一方面基金净值会因全球股市的整体变化而出现价格波动。另一方面，各国各地区处于不同的产业经济循环周期之中，这也将对基金的投资绩效产生影响。同时，境外证券市场因特有的社会政治环境、法律法规、市场状况和经济发展趋势，对于负面的特定事件的反映存在诸多差异；另外，部分投资市场如美国、英国、香港等证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，使得这些国家或地区证券的每日涨跌幅空间相对较大等。上述因素可能会带来市场的急剧波动，从而导致投资风险的增加。

（2）汇率风险

本基金以人民币募集和计价，经过换汇后主要投资于美国市场以美元计价的金融工具，因此人民币与美元之间汇率的变动将影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险。

（3）法律和政治风险

由于各个国家或地区适用不同法律法规的原因，可能导致本基金的某些投资行为在部分国家或地区受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失的可能性。

基金所投资的国家或地区因政治局势变化（如罢工、暴动、战争等）或法令的变动，可能导致市场的较大波动，从而给本基金的投资收益造成直接或间接的影响。

（二）重要提示

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作出实质性判断或

保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应经友好协商解决，如经友好协商未能解决的，则任何一方有权按《基金合同》的约定提交仲裁，仲裁机构见《基金合同》。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 www.gtfund.com 或咨询客服电话：400-888-8688

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书及更新
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料