

纳斯达克100交易型开放式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 (QDII-ETF)	基金代码	513100
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	2013-04-25	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2013-05-15
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	交易型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	艾小军	开始担任本基金基金经理的日期	2023-05-10
		证券从业日期	2001-05-01
场内简称	纳指ETF		
扩位简称	纳指ETF		
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

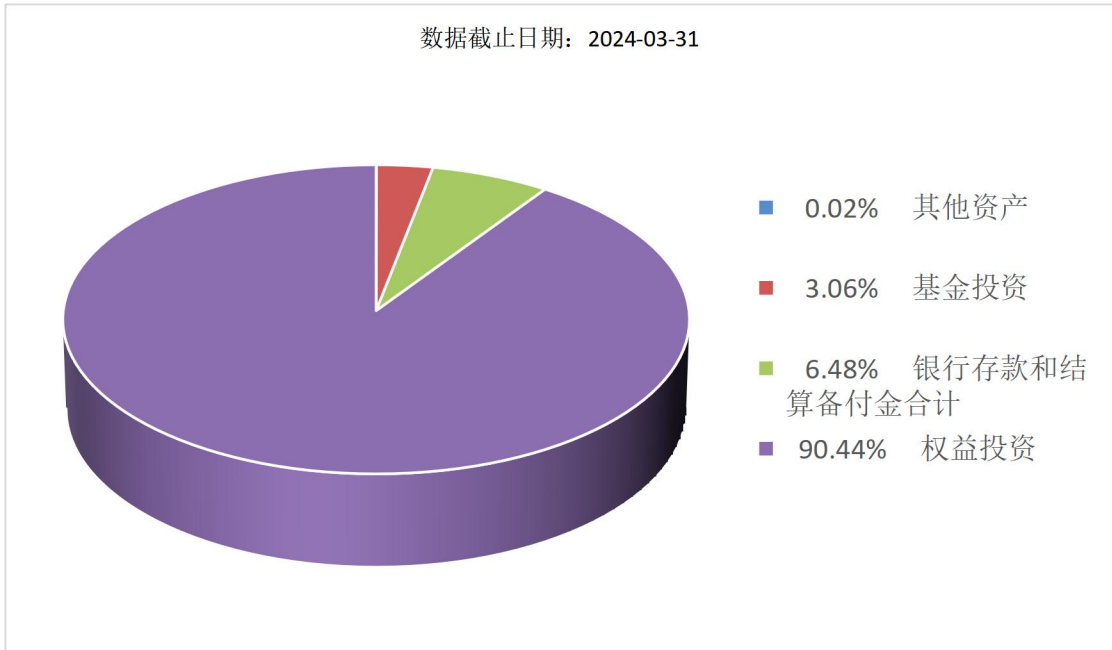
详见本基金招募说明书（更新）“四、基金的投资”。

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金（包括ETF）、依法发行或上市的其他股票、固定收益类资产、银行存款、货币市场工具、股指期货等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监

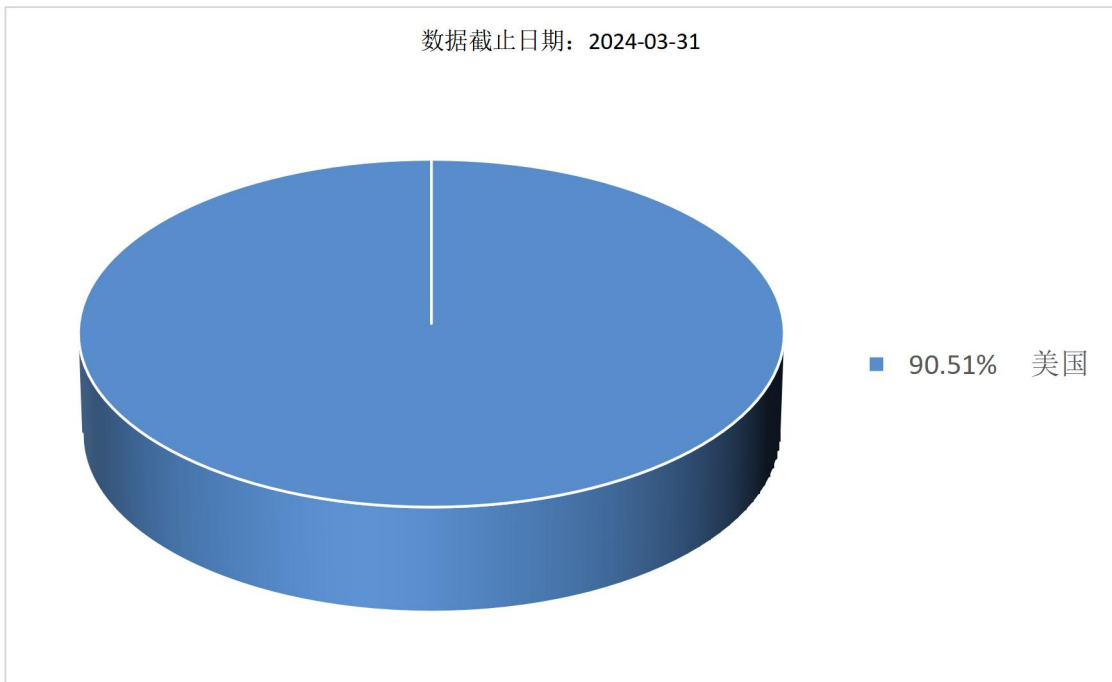
	<p>会的相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。</p> <p>本基金的标的指数为纳斯达克100指数（Nasdaq-100 Index）及其未来可能发生的变更。</p>
主要投资策略	<p>本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>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%，年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</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、且以本基金的标的指数为投资标的的指数型公募基金（包括ETF）。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>本基金的业绩比较基准为标的指数收益率（经汇率调整后的总收益指数收益率）。本基金的标的指数为纳斯达克100指数（Nasdaq-100 Index）。</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，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

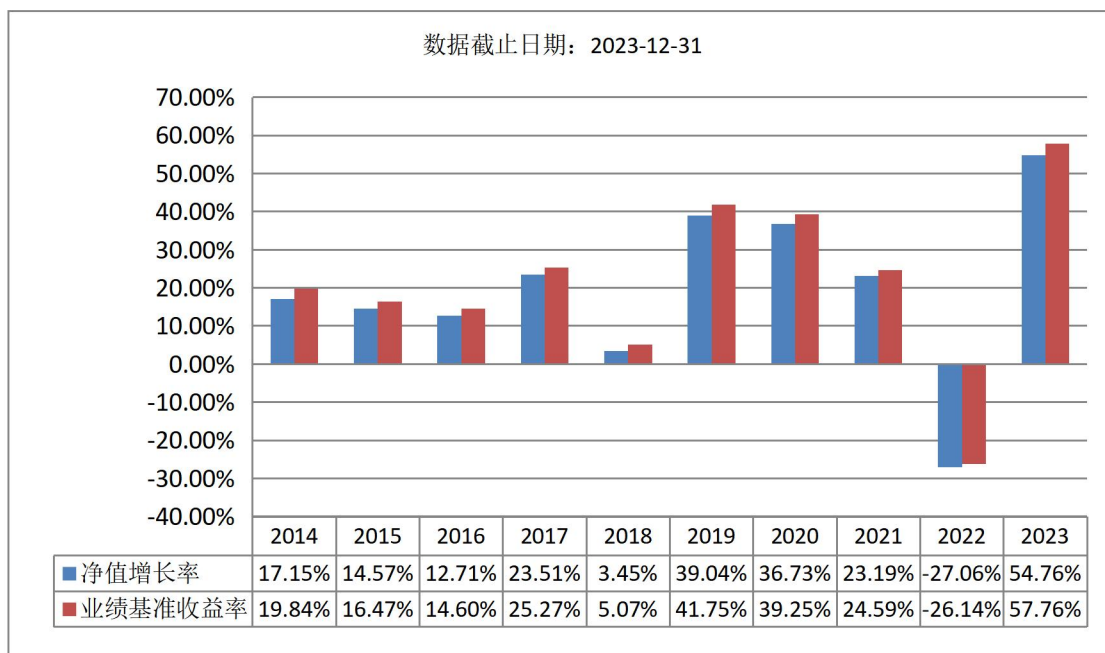
投资组合资产配置图表



区域配置图表



(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

场内交易费用以证券公司实际收取为准。

申购费：

投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

赎回费：

投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

（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	0.60%	基金管理人、销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
审计费用	120,000.00	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	本基金每日应支付的指数使用费，对于每日基金资产净值中不超过 1 亿美元或等值人民币的部分，在次日按该部分的 0.06% 的年费率计提；对于每日基金资产净值中超过 1 亿美元或等值人民币的部分，在次日按该部分的 0.04% 的年费率计提。指数使用费每年不得低于 40,000 美元或等值人民币。	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）
0.85%

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。

本基金面临的主要风险有本基金特有的风险、投资风险、运作风险、不可抗力风险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。

本基金特有风险：

1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险及跟踪误差控制未达约定目标的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

(1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使ETF基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；

(2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使ETF基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；

(3) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使ETF基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

(4) 成份股派发现金红利、送配等所获收益可能导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度；

(5) 由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；

(6) 在ETF基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对ETF基金的收益产生影响，从而影响ETF基金对标的指数的跟踪程度；

(7) 如果指数编制机构发布的指数数据出现错误，基金投资组合的收益率与标的指数的收益率也可能发生偏离；

(8) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；基金申购与赎回带来的现金变动等。

如因标的指数编制规则调整或其他因素导致本基金的跟踪误差控制未达约定目标,本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

4、标的指数变更的风险

尽管可能性很小,但根据基金合同规定,如出现变更标的指数的情形,本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变,投资组合将随之调整,基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致,投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

5、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护,未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护,本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异,影响投资收益。

6、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌,发生成份股停牌时可能面临如下风险:

(1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(2) 停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格折溢价水平。

(3) 若成份股停牌时间较长,在约定时间内仍未能及时买入或卖出的,则该部分款项将按照本招募说明书的约定方式进行结算,由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

(4) 在极端情况下,标的指数成份股可能大面积停牌,基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回对价,由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施,投资者将面临无法赎回全部或部分ETF份额的风险。

本基金运作过程中,当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当按照持有人利益优先的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整,可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

7、基金管理人代理申赎投资人买券卖券的风险

因涉及境外市场股票的买卖,在投资人申购、赎回本基金时,本基金组合证券中全部或部分证券需以一定数量的现金进行现金替代,并由基金管理人按照招募说明书的规定代理申赎投资人进行相关证券买卖,投资人需承受买入证券的结算成本和卖出证券的结算金额的不确定性(含汇率波动风险)。

8、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金的运作力求使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内,但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响,存在不同于基金份额净值的情形,即存在价格折溢价的风险。

9、退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市,或被基金份额持有人大会决议提前终止上市,导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

10、申购失败的风险

如果投资人申购时未能提供符合要求的申购对价,或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资人的申购申请,则投资人的申购申请失败。此外,如果基金可用的外汇额度不足,申购赎回代理券商应付资金不足或出现违约,投资人的申购申请也可能失败。

11、赎回失败的风险

如果投资人赎回时持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,或者投资人在登记结算机构办理基金份额交收时持有的符合要求的基金份额不足,或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资人的赎回申请,则投资人的赎回申请失败。另外,基金管

理人可能根据成份市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位,由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回,而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

12、投资人参考 IOPV 做出投资决策的风险和 IOPV 计算错误的风险

IOPV 与实时的基金份额净值存在差异, IOPV 计算可能出现错误, 投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失。

13、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理, 存在以下风险:

(1) 受多种因素影响, 申购赎回代理券商代理申购、赎回业务可能受到限制、暂停或终止, 从而影响投资人申购、赎回。

(2) 登记结算机构可能调整结算制度, 从而对投资人基金份额、资金等的结算方式发生变化, 制度调整可能给投资人带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3) 证券交易所、期货交易所、证券与期货登记结算机构、申购赎回代理券商、基金托管人及其他代理机构可能违约, 导致基金或投资人利益受损的风险。

14、管理风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资人利益的风险。

相关当事人在业务各环节操作过程中, 可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险, 例如, 申购赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为及交易错误等风险。

(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