

国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金（国泰全球绝对收益型基金优选-人民币）基金产品资料概要

编制日期：2020年8月21日

送出日期：2020年8月28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	国泰全球绝对收益型基金优选	基金代码	001936
下属基金简称	国泰全球绝对收益型基金优选-人民币	下属基金代码	001936
基金管理人	国泰基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
境外投资顾问	-	境外托管人	中国银行（香港）有限公司 BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED
基金合同生效日	2015-12-03		
基金类型	基金中基金	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	吴向军	开始担任本基金基金经理的日期	2015-12-03
		证券从业日期	2004-07-01
其他	《基金合同》生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元人民币或等值货币情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。		

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）“第四部分 基金的投资”。

投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，追求稳健的投资回报。

投资范围

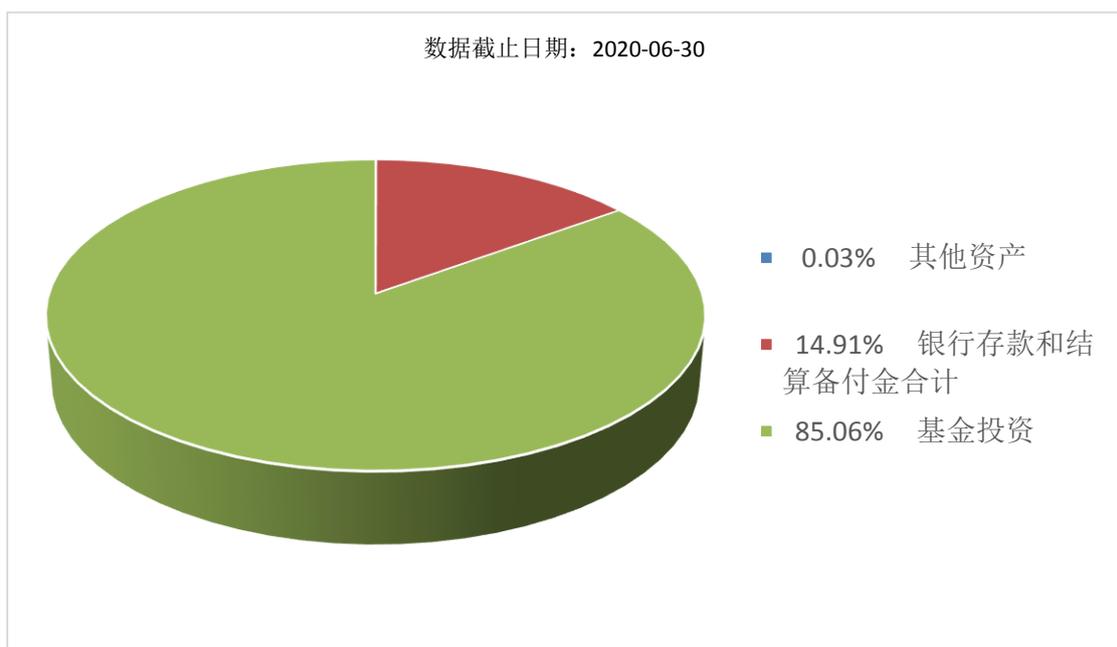
本基金的投资范围为在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的境外公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF））、银行存款、货币市场工具等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

基金的投资组合比例为：本基金投资于境外公募基金资产的比例不低于基金资产的80%，投资于基金合同界定的绝对收益型基金占非现金基金资产的比例不低于80%，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%（其中，现金不包括结

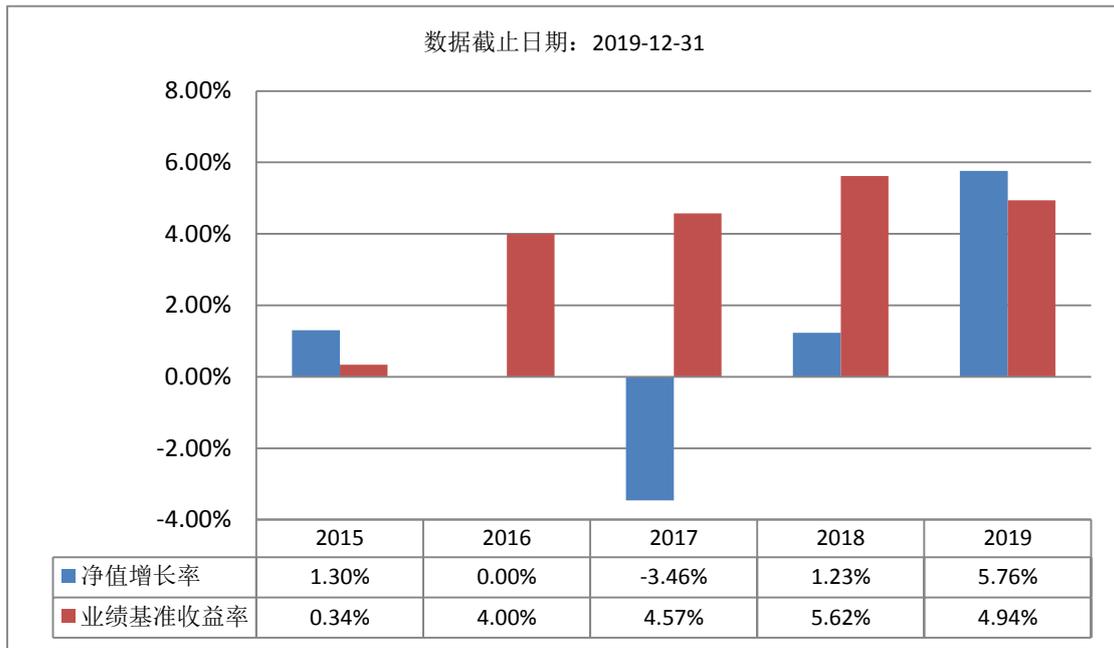
	<p>算备付金、存出保证金和应收申购款等)。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。</p>
主要投资策略	<p>本基金通过定量和定性相结合的方式优选境外绝对收益型公募基金(以下简称“标的基金”),按照资产管理人、绝对收益目标的实现策略等角度适度分散本基金的配置,以期实现基金资产的稳健增值。</p> <p>1、境外绝对收益型公募基金的界定:</p> <p>本基金管理人对境外绝对收益型公募基金的界定,主要依据标的基金的名称和投资目标,即1)基金名称中含绝对收益(absolute return/total return)字样;或2)以追求绝对收益为主要投资目标的基金,例如以追求在不同市场环境下获得长期正回报为投资目标的基金,以追求获得资产增值的同时实现风险最小化为投资目标的基金等。其实现绝对收益目标的策略包括但不限于:①多资产配置策略(Multi-Asset Allocation);②全球配置策略(Global Allocation);③市场中性策略(Market Neutral);④长短仓对冲策略(Long/Short);⑤全球宏观策略(Global Macro);⑥事件驱动策略(Event driven);⑦套利策略(Arbitrage);⑧多重策略(Multi-Strategy)</p> <p>2、基金投资策略:</p> <p>1)定量分析策略;2)定性分析策略。</p>
业绩比较基准	美国3年期国债到期收益率+3%
风险收益特征	本基金主要投资于境外绝对收益型基金,属于证券投资基金中的预期风险和预期收益中等的品种,其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

(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



(三) 自基金合同生效以来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：1、本基金合同生效当年不满完整自然年度，按当年实际运作期限计算净值增长率，不按整个自然年度进行折算。

2、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 < 100 万元	1.50%	
	100 万元 ≤ M < 300 万元	1.00%	
	300 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	0.30%	
	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
管理费	1.00%
托管费	0.28%

其他费用

《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用；基金的银行汇划费用；基金进行外汇兑换交易的相关费用；基金依照有关法律法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）（合称“税收”）；基金的开户费用、账户维护费用；因更换境外托管人（由于基金托管人的原因更换境外托管人除外）而进行的资产转移所产生的费用；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其他费用。

注： 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。

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。

本基金投资于境外公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF）），基金净值会因为境外证券市场及汇率波动等因素产生波动。本基金面临的主要风险包括：一是本基金特有风险；二是境外投资风险；三是开放式基金风险，包括利率风险、流动性风险、信用风险、操作风险、会计核算风险、交易结算风险、技术系统运行风险、通讯风险、巨额赎回风险、不可抗力风险等；四是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。

1、本基金特有风险

（1）投资标的风险

本基金主要投资于境外公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF））。这些基金都会随着当地市场的波动而有所起伏。

（2）主动管理风险

指基金经理对基金的主动性操作导致的风险。本基金是一只主动管理型基金，在本基金精选基金的操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的基金的业绩表现并不一定持续的优于其他基金。

（3）境外证券投资额度限制引致的风险

本基金将按照中国证监会和外管局核准的额度（美元额度需折算为人民币）设定基金募集期内的募集规模上限。

基金合同生效后，基金的资产规模不受上述限制，但基金管理人有权根据基金的境外证券投资额度控制基金申购规模并暂停基金的申购。

2、境外投资风险

（1）境外市场风险

境外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境外公募基金（包括开放式基金和交易型开放式指数基金（ETF）），所以，当境外证券市场受到特有的政治环境、法律法规、市场状况、经济发展趋势、股市波动等因素影响时，基金的净值也会发生相应变化，并最终影响本基金的投资收益。

（2）汇率风险

由于本基金在全球范围内进行投资，而本基金的记账货币是人民币，因此在投资外汇计价资产时，除了证券本身的收益/损失外，人民币的升值会给基金资产带来额外的损失，从而对基金净值和投资者收益产生影响。

（3）政治风险

不同国家或地区的内外政治关系变化，如政府更迭、政策调整、制度变革、国内出现动

乱、对外政治关系发生危机等，都可能对本基金所参与的投资市场或投资产品造成直接或者间接的负面冲击。另外，不同国家或地区的财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等宏观政策发生变化，导致市场波动而影响基金收益，产生风险。

（4）政府管制风险

政府管制风险是指所投资国家或地区可能会采取某些管制措施，比如资本或外汇控制、资产冻结或扣压以及征收高额税款等给基金收益带来的不利影响。

（5）税务风险

税务风险是指本基金投资各国或地区市场时，因各国、地区税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向各国、地区税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响；各国、地区的税收法律法规的规定可能变化，或者加以具有追溯力的修订，所以可能须向该等国家缴纳本基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项都可能对本基金造成影响。

（6）法律风险

由于各个国家或地区适用不同法律法规的原因，可能基金的某些投资行为在部分国际或地区受到限制或合同不能正常执行，或者由于税制、破产制度的改变等法律上的原因，给交易者带来损失的可能性。

另外，由于基金合同部分条款在法律上引起争议或诉讼，或由于现行的法律法规、税制、估值等制度的改变，给基金带来损失的可能性。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，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