

# 国泰国证有色金属行业指数证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2021年3月30日

送出日期：2021年4月2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	国泰国证有色金属行业指数	基金代码	160221
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
基金合同生效日	2021-01-01	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2021-01-20
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	谢东旭	开始担任本基金基金经理的日期	2021-01-01
		证券从业日期	2011-04-01
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5000万元情形的，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）“第十一部分 基金的投资”。

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
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，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、银行存款、权证、股指期货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）。 本基金所持有的股票资产占基金资产的比例为90%—95%，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的90%，且不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。权证投资不高于基金资产净值的3%。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、股指期货投资策略。

<b>业绩比较基准</b>	国证有色金属行业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
<b>风险收益特征</b>	本基金为股票型指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、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

## (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

### 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)	-	0.00%	
赎回费	N < 7 天	1.50%	场外
	7 天 ≤ N < 365 天	0.70%	场外
	365 天 ≤ N < 730 天	0.25%	场外
	N ≥ 730 天	0.00%	场外
	N < 7 天	1.50%	场内
	N ≥ 7 天	0.70%	场内

注：场内交易费用以证券公司实际收取为准。

#### (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	0.22%
其他费用	标的指数使用许可费；基金上市费及年费；《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、律师费和诉讼费；基金份额持有人大会费用；基金的证券/期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金证券/期货账户的开户费用、银行账户维护费用；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。

本基金面临的主要风险有系统性风险、非系统性风险、流动性风险、运作风险、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、本基金特定风险及其他风

险等。

本基金特定风险：

#### 1、指数化投资风险

##### (1) 标的指数的系统性风险

标的指数成份股的价格可能由于政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动。当国证有色金属行业指数下跌时，本基金面临基金净值与国证有色金属行业指数同步下跌的风险。

##### (2) 投资替代风险

因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代，由此可能对基金产生不利影响。

##### (3) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数为行业指数，并不代表整个股票市场，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存在偏离。

##### (4) 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

由于基金投资过程中存在流动性风险、交易成本和国证有色金属行业指数成份股调整等情况导致基金投资组合回报与标的指数回报存在跟踪偏离风险，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标。主要影响因素可能包括：

①基金运作过程中发生的费用，包括交易成本、市场冲击成本、管理费和托管费等；

②当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

③投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、摘牌或流动性差等情形时，基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大；

④在指数化投资过程中，管理人对指数基金的管理能力，如跟踪技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对业绩比较基准的跟踪程度；本基金将进行被动型的股票投资并通过多项风险控制方式降低跟踪风险。

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。

##### (5) 标的指数变更风险

根据《基金合同》的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的风险收益特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

##### (6) 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。

##### (7) 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款项，由此基金管理人可能采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

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。

## 2、特有的运作风险

### (1) 上市交易风险

本基金在基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，本基金基金份额在深圳证券交易所上市交易。由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖本基金的上市份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致本基金的上市份额产生流动性风险。

### (2) 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。

### (3) 折/溢价交易风险

本基金上市交易后，由于受到市场供求关系的影响，基金份额的交易价格与基金份额净值可能出现偏离并出现折/溢价风险。

3、本基金可投资股指期货，需承受投资股指期货带来的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于股指期货通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈。并且由于股指期货定价复杂，不适当的估值可能使基金资产面临损失风险。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能使投资人权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资人带来损失。

## 4、科创板股票投资风险

本基金可投资国内上市的科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于如下特殊风险：

### (1) 退市风险

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；且不设暂停上市、恢复上市和重新上市制度，科创板上市公司股票退市风险更大。

### (2) 市场风险

科创板股票集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数公司为初创型公司，公司未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，科创板股票市场风险加大。

科创板股票竞价交易设置较宽的价格涨跌幅限制，首次公开发行股票上市的股票，上市后前5个交易日不设价格涨跌幅限制，其后涨跌幅比例为20%，可能产生股票价格大幅波动的风险。

### (3) 流动性风险

科创板整体投资门槛较高，科创板的投资者可能以机构投资者为主，科创板股票流动性可能弱于其他市场板块，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

### (4) 集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量股票，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

### (5) 系统性风险

科创板上市公司均为市场认可度较高的科技创新公司，在公司经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板股票相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

#### (6) 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板上市公司带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板企业也会带来政策影响。

#### (二) 重要提示

中国证监会对本基金变更的备案，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](http://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