国泰纳斯达克100指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018年第二号)

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
重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2010年2月24日证监许可【2010】208号文核准募集。本基金基金合同于2010年4月29日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但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,勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

本基金投资于美国证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前,需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认(申)购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担基金投资中出现的各类风险。本基金投资中出现的风险主要分为两类:一是国外投资产品风险,包括商外市场风险、汇率风险、法律和政治风险等;二是开放式基金风险,包括共享风险、流动性风险、信用风险、剔除风险风险、操作或技术风险、会计核算风险、税务风险、业主监风险等。本基金为跟踪美国纳斯达克100指数的指数基金,属于较高风险、较高收益的投资品种,投资人在购买此类基金时应当充分了解其可能存在的投资风险。

投资者风险,投资人在认(申)购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩或其他基金业绩表现的保证。基金管理人建议投资人根据自身的风险偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年10月29日,投资组合报告为2018年3季度报告,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日。

一、基金的名称

国泰纳斯达克100指数证券投资基金

基金的类别:股票型基金。

基金的运作方式:契约型开放式。

二、投资目标

通过严格的投资程序内容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。

四、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指数成分股,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%。

如法律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。

五、投资策略

本基金原则上采取完全复制策略,因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。

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)。

开放式指数基金面临巨额赎回或者大规模申购的风险,或导致调整股票的交易策略以及基金每日现金流入/流出的建仓/变现策略,或分散投资的再投资策略等。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。

另外,本基金基于此产品特性的需要,将投资于与本基金有相应的投资目标、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相应标的指数的成份股,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。

未来,随着全球证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

六、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:

纳斯达克100指数(Nasdaq-100 Index)收益率(总收益指数收益率)

纳斯达克100指数于1985年1月31日发布,涵盖了纳斯达克股票交易市场上100只市值最大的非金融类上市公司,反映了科技、工业、零售、电子、生物技术、医疗保健、交通、媒体和服务公司等行业的整体走势。该指数具有宽泛的分散性,赢得了投资人和市场专家的广泛认同。

本基金标的指数的变更程序为:

1、当标的指数变更对基金分额持有人利益无实质性不利影响,但信息不报不披露的指数由于编制机构更名或指数更名等情况而变更,但指数成份股和指数编制方法无重大变更时,标的指数的变更程序为:基金管理人与基金托管人沟通协商,在取得基金托管人同意的情况下,报中国证监会备案,在中国证监会备案概准后,应至少在标的指数变更实施日前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

2、当标的指数提供商NASDAQ OMX集团取消对本基金使用标的指数的授权,或标的指数停止编制发布等非因基金当事人原因导致基金无法再继续使用标的指数的情形时,基金管理人按照相关基金份额持有人会议表决的原则,依据的法律法规,在不损害基金当事人利益的情况下拟采用的标的指数变更方案是否会对基金份额持有人利益产生实质性不利影响,决定是否采用替代其基金份额持有人大会的方式决定标的指数变更事宜。

3、当标的指数的编制方法发生重大变更,或标的指数的市场代表性、流动性等发生变化,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数出时,基金管理人认为标的指数已不再适宜作为跟踪标的时,则本基金管理人应根据基金份额持有人合法权益的原则,在基金份额持有人大会、由基金份额持有人大会对标的指数的变更事宜作出决议。基金份额持有人大会决议日中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")备案,并在证监会备案概准后,报证券交易所备案。基金管理人执行生效的基金份额持有人大会决议。

七、风险收益特征

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,具有与指数市场相似的风险收益特征。

八、基金投资组合报告

本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规定,于2018年10月23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。

本投资组合报告所载数据截止2018年9月30日,本报告所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	835,214,433.52	79.68
	其中:普通股	821,489,226.07	78.37
	存托凭证	13,725,207.45	1.31
	优先股	–	–
	房地产信托	–	–
2	基金投资	2,050,180.45	0.20
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中:远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	191,192,494.37	18.24
8	其他各项资产	19,759,873.22	1.89
9	合计	1,048,216,982.06	100.00

2、报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	835,214,433.52	81.77
合计	835,214,433.52	81.77

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资明细

(1)报告期末按指数投资行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
信息技术	364,792,105.62	35.72
非必需消费品	139,511,974.78	13.66
保健	77,372,640.10	7.58
必需消费品	48,146,999.35	4.71
工业	16,641,331.57	1.63
电信服务	188,749,382.10	18.48
能源	–	–
公用事业	–	–
材料	–	–
金融	–	–
地产	–	–
合计	835,214,433.52	81.77

注:以上分类采用交易行业分类标准(GICS)。

(2)报告期末按指数投资行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有按指数投资行业分类的股票及存托凭证。

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

(1)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克	美国	69,722	108,272,033.41	10.60
2	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克	美国	6,822	94,000,594.51	9.20
3	MICROSOFT CORP	微软一T	MSFT US	纳斯达克	美国	103,435	81,379,979.45	7.97
4	ALPHABET INC-CL C	Alphabet公司	GOOG US	纳斯达克	美国	4,824	39,605,613.21	3.88
5	FACEBOOK INC-A	Facebook公司	FB US	纳斯达克	美国	33,800	38,239,739.24	3.74
6	ALPHABET INC-CL A	Alphabet公司	GOOGL US	纳斯达克	美国	4,211	34,967,069.08	3.42
7	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克	美国	66,396	21,599,771.97	2.11
8	CISCO SYSTEMS INC	思科一T	CSCO US	纳斯达克	美国	64,246	21,501,406.70	2.11
9	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达克	美国	8,702	16,822,643.61	1.65
10	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克	美国	65,462	15,946,050.40	1.56

(2)期末按股票投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有按股票投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI DEC18	–	–

注:投指期货投资采用当日无负债结算制度,相关价值已包含在结算备付金中,因此衍生金融工具项下股指期货投资按抵前后的净额列示。为人民币零元。本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细为:NASDAQ 100 E-MINI DEC18买入持仓量102手,合约市值人民币17,024,906.39元,公允价值变动人民币72,911,803.14元。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	PROSHARES ULTRAPRO QQQ	ETF基金	开放式	ProShares Trust	1,027,711.20	0.10
2	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1	ETF基金	开放式	Invesco Ltd	1,022,469.25	0.10

10、投型投资组合报告附注

(1)本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

(2)基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

(3)其他资产构成:

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,423,902.07
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	115,645.41
4	应收利息	45,203.69
5	应收申购款	10,175,122.05
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	19,759,873.22

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

九、基金的业绩

基金业绩截止日为2018年6月30日,并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守,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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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
2010年4月29日至2010年12月31日	12.10%	0.58%	11.11%	1.35%	0.99%	-0.77%
2011年度	-3.08%	1.46%	3.66%	1.57%	-6.74%	-0.11%
2012年度	15.11%	0.89%	15.35%	0.98%	-3.24%	-0.09%
2013年度	29.33%	0.72%	36.92%	0.76%	-7.59%	-0.06%
2014年度	17.36%	0.81%	19.40%	0.86%	-2.04%	-0.05%
2015年度	17.03%	1.17%	9.75%	1.17%	7.28%	0.00%
2016年度	12.79%	1.04%	7.27%	1.04%	5.52%	0.00%
2017年度	23.94%	0.70%	32.99%	0.66%	-9.05%	0.04%
2018年上半年	10.52%	1.34%	10.65%	1.31%	-0.13%	0.03%
2010年4月29日至2018年6月30日	243.19%	1.00%	286.11%	1.09%	-42.92%	-0.09%

注:同期业绩比较基准以美元计价,本包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

十、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:国泰基金管理有限公司

设立日期:1998年4月5日

住所:中国(上海)自由贸易试验区浦东大道1200号2层225室

办公地址:上海市虹口区公平路18号8号楼嘉里大厦16层-19层

法定代表人:陈勇胜

注册资本:壹亿贰仟万元人民币

联系人:徐茵

联系电话:021-31089000,40088888688

股东结构:

股东名称	股权比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

(二)基金管理人管理基金的基本情况

截至2018年10月29日,本基金管理人共管理93只开放式证券投资基金:国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金(国泰金龙系列证券投资基金(包括2只子基金,分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金)、国泰金龙精选证券投资基金、国泰金龙行业混合证券投资基金、国泰金龙品牌证券投资基金、国泰金龙潜力证券投资基金、国泰金龙竞争力证券投资基金、国泰金龙焦点证券投资基金、国泰金龙中小盘证券投资基金、国泰金龙成长混合型证券投资基金(由金鹰证券投资基金转型而来)、国泰金龙成长证券投资基金(由金鹰证券投资基金转型而来)、国泰金龙精选证券投资基金(由金鹰证券投资基金转型而来)、国泰金龙行业证券投资基金(由金鹰证券投资基金转型而来)、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰价值经典证券投资基金、国泰金龙成长优选证券投资基金(LOF)、国泰金龙证券投资基金(LOF)、国泰金龙证券投资市市场基金、国泰金龙证券投资基金(LOF)、国泰金龙证券投资基金(LOF)、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰金龙证券投资基金(LOF)、上证180金融交易型开放式指数证券投资基金(国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金)、国泰金龙证券投资基金(LOF)、国泰金龙证券投资基金(LOF)、国泰金龙证券投资基金(LOF