

国泰策略价值灵活配置混合型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	国泰策略价值灵活配置混合	基金代码	020022
基金管理人	国泰基金管理有限公司	基金托管人	招商银行股份有限公司
基金合同生效日	2017-05-16		
基金类型	混合型	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	吴可凡	开始担任本基金基金经理的日期	2023-09-05
		证券从业日期	2019-06-24
其他	基金合同生效后,连续 20 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 万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续 60 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

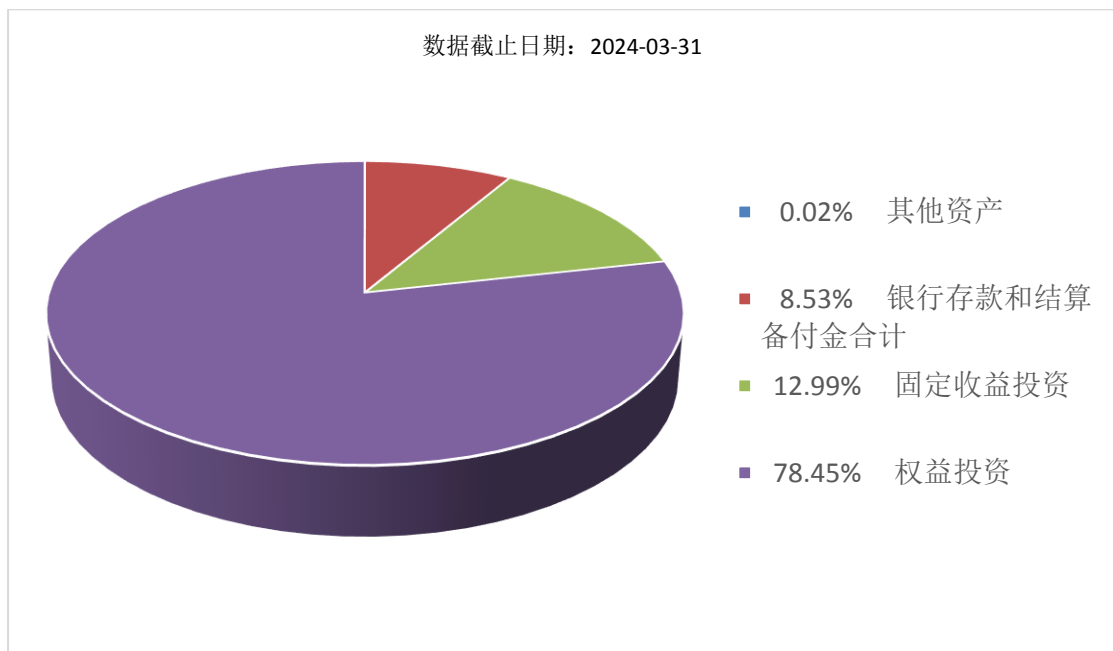
详见本基金招募说明书(更新)“九、基金的投资”。

投资目标	本基金力图通过灵活的大类资产配置,积极把握个股的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
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,包括国内上市交易的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及中国证监会允许投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 其中,股票、权证等资产占基金资产的30%-80%,债券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的20%-70%。其中,本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,现金不包括结算备付

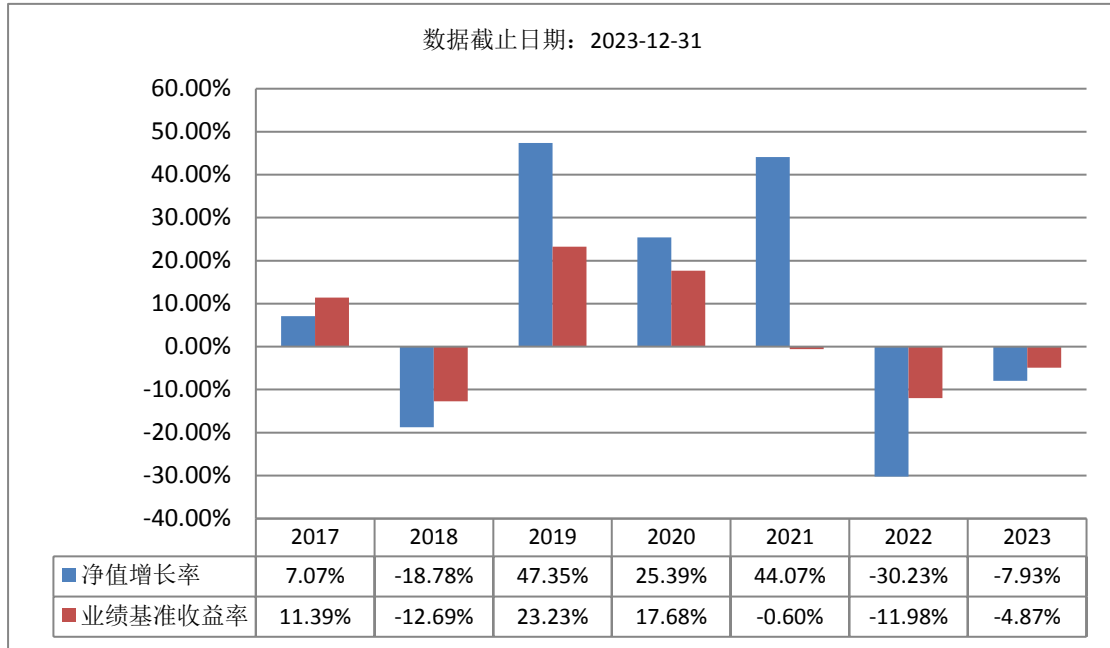
	金、存出保证金和应收申购款等。股指期货的投资比例及限制按照法律法规及中国证监会相关规定执行。 当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。
主要投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、债券投资策略；5、权证投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股指期货投资策略。
业绩比较基准	60%*沪深300指数收益率+40%*中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金是一只灵活配置的混合型基金，属于基金中的中高风险品种，本基金的风险与预期收益介于股票型基金和债券型基金之间。

(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	1.20%	
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%	
	500 万元 ≤ M < 1,000 万元	0.40%	
	M ≥ 1,000 万元	1000 元 / 笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	
	30 天 ≤ N < 180 天	0.50%	
	180 天 ≤ N < 365 天	0.10%	
	365 天 ≤ N < 730 天	0.05%	
	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	1.20%	基金管理人、销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
审计费用	35,000.00	会计师事务所
信息披露费	80,000.00	规定披露报刊
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）
1.54%

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市场风险、管理风险、流动性风险、法律文件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、投资股指期货的特定风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险、和操作风险。具体为：

（1）市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。市场风险是股指期货投资中最主要的风险。

（2）流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

（3）基差风险是指股指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险。

（4）保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

（5）信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

（6）操作风险是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

2、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

科创板为新增板块，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。

3、存托凭证投资风险

本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。

(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 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

