国泰中证机床交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（国泰中证机床ETF发起联接C）基金产品资料概要更新

编制日期：2026年9月11日

送出日期：2026年9月21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	国泰中证机床 ETF 发起联接	**基金代码**	017471
下属基金简称	国泰中证机床 ETF 发起联接 C	**下属基金代码**	017472
基金管理人	国泰基金管理有限公司	**基金托管人**	中国邮政储蓄银行股份有限公司
基金合同生效日	2022-12-13		
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	苗梦羽	**开始担任本基金基金经理的日期**	2022-12-13
		证券从业日期	2015-08-17
其他	《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。 《基金合同》生效满三年后基金继续存续的，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 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 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

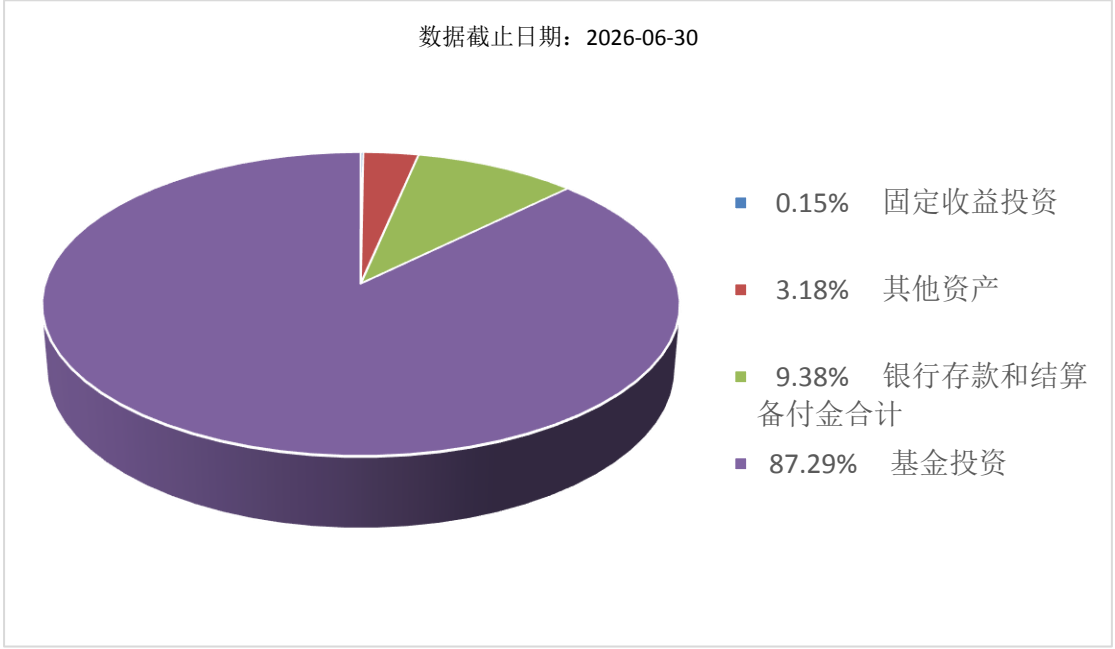
详见本基金招募说明书“第九部分 基金的投资”。

投资目标	通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股（含存托凭证）、备选成

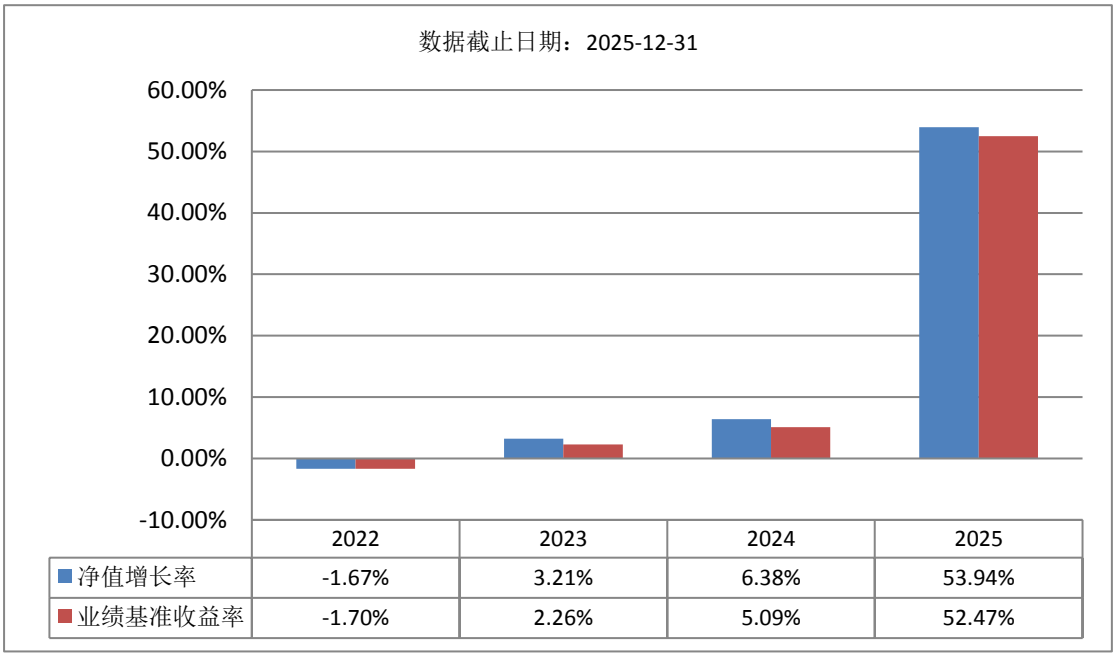
	份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、股指期货、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。 基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 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。 本基金的标的指数为中证机床指数及其未来可能发生的变更。
主要投资策略	1、资产配置策略；2、目标ETF投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、可转换债券和可交换债券投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、股指期货投资策略；9、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证机床指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型指数基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

（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、自2022年12月22日起计算并确认C类基金的申购份额。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）	-	0.00%	
赎回费	N < 7 日	1.50%	
	N ≥ 7 日	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	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
销售服务费	0.20%	销售机构
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、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。

2、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。

3、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）
0.90%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务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、运作管理风险、流动性风险、本基金特定风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险和其他风险等。

本基金特定风险：

1、目标 ETF 的风险

本基金为 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF，因此目标 ETF 面临的风险（例如目标 ETF 的管理风险、操作风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险和技术风险等风险）可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金为目标ETF的联接基金,但不能保证本基金的表现与目标ETF的表现完全一致，产生差异的原因包括以下几个方面：

（1）投资对象和投资范围的不同，会导致两只基金的业绩有差异；

（2）投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同，会导致两只基金的业绩有差异；

（3）基金规模、投资成本、各种费用与税收的不同，会导致两只基金的业绩有差异。由于两只基金的投资对象和投资范围不同,投资管理方式不同,基金规模也可能不同,所以，本基金的投资成本、各种费用及税收可能不同于目标 ETF；

（4）现金比例及现金管理方式的不同，会导致两只基金的业绩有差异。本基金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,持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。而目标 ETF 则没有这项规定。

2、标的指数的风险

（1）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。

（2）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。

（3）标的指数成份股停牌的风险

1）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，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。

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基金份额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）本基金为 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF，因此目标 ETF 在成份股停牌可能面临的风险（例如目标 ETF 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、跟踪误差加大的风险、投资者无法赎回全部或部分 ETF 份额的风险等）可能直接或间接成为本基金的风险。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离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，使本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送配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（3）成份股派发现金红利、成份股增发、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。

（4）由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本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。

（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等费用的存在，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）在本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，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。

（7）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；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（8）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 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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、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，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

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。

5、本基金可投资资产支持证券，主要存在以下风险：

（1）特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等与基础资产相关的风险；

（2）资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、评级风险等与

资产支持证券相关的风险；

（3）管理人违约违规风险、托管人违约违规风险、专项计划账户管理风险、资产服务机构违规风险等与专项计划管理相关的风险；

（4）政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险等其他风险。

6、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、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会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。

7、基金合同提前终止的风险

本基金为发起式基金，《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。《基金合同》生效满三年后基金继续存续的，连续50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，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。投资人将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

8、参与融资业务的风险

（1）杠杆效应放大风险：本基金通过融资可以扩大交易额度，利用较少资本来获取较大利润，这必然也放大了风险。本基金将股票作为担保品进行融资时，既需要承担原有的股票价格变化带来的风险，又得承担新投资股票带来的风险，还得支付相应的利息或费用，如判断失误或操作不当，会加大亏损。

（2）担保能力及限制交易风险：单只或全部证券被暂停融资、本基金账户被暂停或取消融资资格等，这些影响可能给本基金造成经济损失。此外，本基金也可能面临由于自身维持担保比例低于融资合同约定的担保要求，且未能及时补充担保物，导致信用账户交易受到限制，从而造成经济损失。

（3）强制平仓风险：本基金在从事融资交易期间，如果不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动，导致日终清算后维持担保比例低于警戒线，且不能按照约定追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险，由此可能给本基金造成经济损失。

9、参与转融通证券出借业务的风险

本基金可参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险和其他风险。

（1）流动性风险：指本基金面临大额赎回时可能因转融通证券出借的原因，发生无法及时变现支付赎回款项的风险；

（2）信用风险：指转融通证券出借对手方可能无法及时归还出借证券、无法支付相应权益补偿及相关费用的风险；

（3）市场风险：指证券出借后，可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险；

（4）其他风险：如宏观政策变化、证券市场剧烈波动、个别证券出现重大事件、交易对手方违约、业务规则调整、信息技术不能正常运行等风险。

10、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的风险。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然投资存托凭证。

（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。

基金投资人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