

# 广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金（广发上海金ETF联接A）基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月19日

送出日期：2024年6月24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    | 广发上海金 ETF 联接                                                                                                                                                                                              | 基金代码           | 008986     |
| 下属基金简称  | 广发上海金 ETF 联接 A                                                                                                                                                                                            | 下属基金代码         | 008986     |
| 基金管理人   | 广发基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                | 基金托管人          | 招商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2020-08-05                                                                                                                                                                                                |                |            |
| 基金类型    | 其他类型                                                                                                                                                                                                      | 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    | 姚曦                                                                                                                                                                                                        | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023-07-24 |
|         |                                                                                                                                                                                                           | 证券从业日期         | 2015-07-29 |
| 其他      | 本基金为商品基金。《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 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 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，如持续运作、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。<br>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

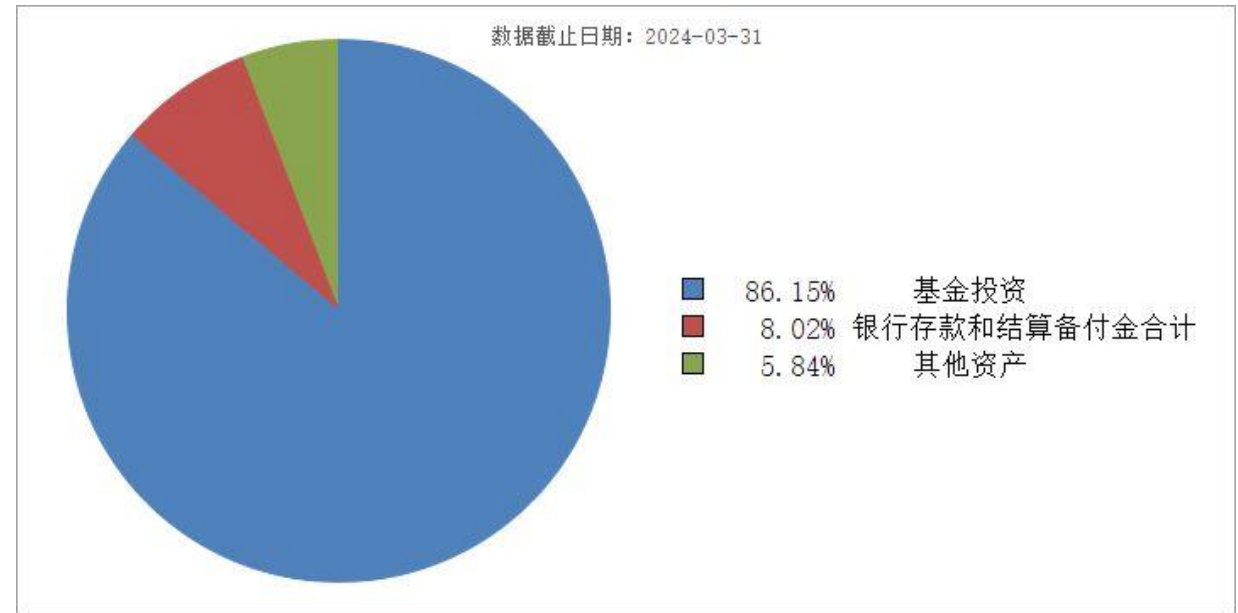
|      |                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金通过主要投资于广发上海金交易型开放式证券投资基金，在跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，争取为投资者提供与上海金集中定价合约表现接近的投资回报。                                                                                                                                                                                                 |
| 投资范围 | 本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标 ETF、上海金集中定价合约及其他在上海黄金交易所上市的黄金现货合约（包括现货实盘合约、现货延期交收合约等）、黄金期货、债券、资产支持证券、债券回购、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，但必须符合中国证监会的规定。本基金可从事黄金现货租赁业务。本基金的目标ETF为广发上海金ETF。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种（包括但不限于挂钩黄金价格的远期合约、期权合约、互换协议等衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>基金的投资组合比例为：投资于目标ETF的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%；现金及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、应收申购款等；黄金合约、黄金期货的投资比例依照法律法规或监管机构规定执行。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。</p>                                                                                                                                                      |
| 主要投资策略 | <p>本基金为广发上海金ETF的联接基金。广发上海金ETF将绝大部分基金财产投资于黄金合约，包括上海金集中定价合约及其他在上海黄金交易所上市的黄金现货合约等，紧密跟踪国内黄金现货价格。</p> <p>为紧密追踪业绩比较基准的表现，本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。</p> <p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，可采用一级市场申购、赎回的方式或证券二级市场交易的方式参与广发上海金ETF交易。</p> <p>为进行风险管理或提高资产配置效率，本基金也可适当投资于黄金现货延期交收合约。</p> <p>为降低基金费用对跟踪偏离度与跟踪误差的影响，本基金可以将持有的黄金现货合约借出给信誉良好的机构，取得租赁收入。</p> |
| 业绩比较基准 | 上海黄金交易所上海金集中定价合约（合约代码：SHAU）的午盘基准价格收益率 $\times 95\%$ +活期存款利率（税后） $\times 5\%$                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 风险收益特征 | 本基金为广发上海金ETF的联接基金。长期来看，本基金具有与目标ETF及其所代表的国内黄金现货品种的风险收益类似的风险收益特征。                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

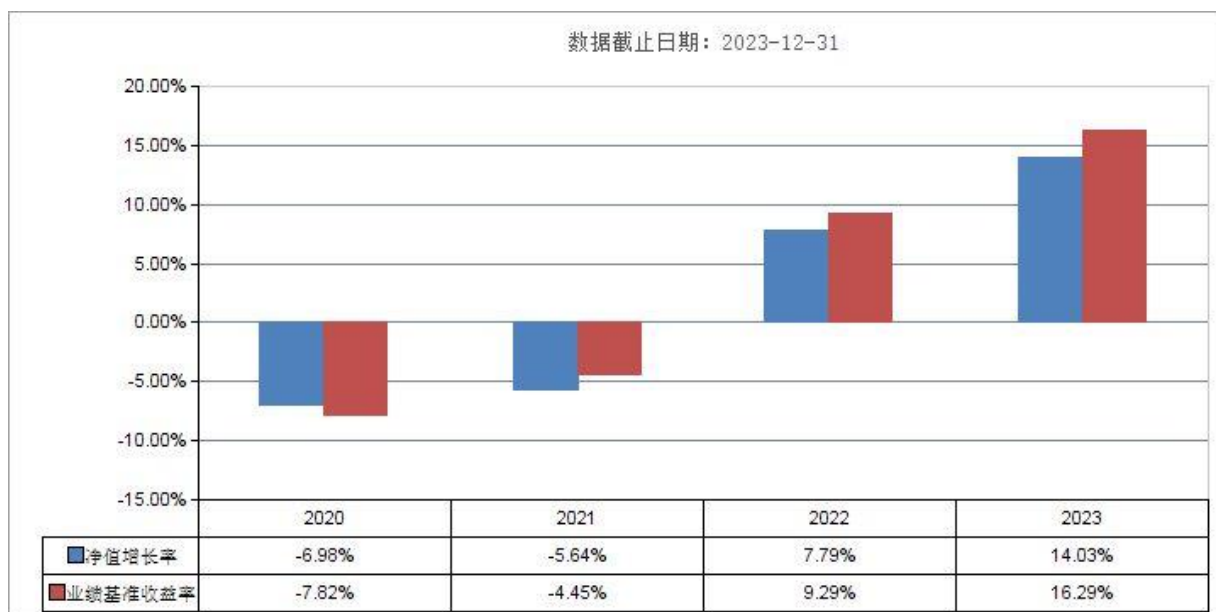
注：详见《广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金招募说明书》及其更新文件中“基金的投资”。

(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、本基金份额成立当年（2020年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。  
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)<br>/持有期限 (N) | 收费方式/费率  | 备注    |
|----------|-----------------------------|----------|-------|
| 申购费（前收费） | M < 100 万元                  | 0.60%    | 非特定客户 |
|          | 100 万元 ≤ M < 300 万元         | 0.40%    | 非特定客户 |
|          | 300 万元 ≤ M < 500 万元         | 0.20%    | 非特定客户 |
|          | M ≥ 500 万元                  | 1000 元/笔 | 非特定客户 |
|          | M < 100 万元                  | 0.06%    | 特定客户  |
|          | 100 万元 ≤ M < 300 万元         | 0.04%    | 特定客户  |
|          | 300 万元 ≤ M < 500 万元         | 0.02%    | 特定客户  |
|          | M ≥ 500 万元                  | 1000 元/笔 | 特定客户  |
| 赎回费      | N < 7 日                     | 1.50%    |       |
|          | 7 日 ≤ N < 180 日             | 0.10%    |       |
|          | N ≥ 180 日                   | -        |       |

注：1、本基金的申购费用由投资者承担，可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。基金销售机构可以对销售费用实行一定的优惠，具体以实际收取为准。  
2、特定投资者通过直销中心申购本基金时，方适用上述特定客户申购费率。特定投资群体（特定投资者）范围及具体费率优惠以基金管理人发布的相关公告为准。

#### （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/年费率或金额                                                                                                                           | 收费方        |
|-------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| 管理费   | 0.50%                                                                                                                                 | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费   | 0.10%                                                                                                                                 | 基金托管人      |
| 审计费用  | 15,500.00                                                                                                                             | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 50,000.00                                                                                                                             | 规定披露报刊     |
| 其他费用  | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户及维护费用等费用，以及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。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。 |            |
|       |                                                                                                                                       | 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；  
本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费和托管费。  
2、审计费用、信息披露费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（金额单位为人民币元）。

### （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） |
|--------------|
| 0.76%        |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）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。

#### 1、本基金特有风险

##### （1）黄金市场波动风险

本基金直接或间接投资黄金合约，包括上海金集中定价合约及其他在上海黄金交易所上市的黄金现货合约等。因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等多种因素的共同影响，黄金合约价格的变化可能导致基金收益水平的波动，产生系统性风险。

##### （2）基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险

本基金的净值表现与业绩比较基准同期表现之间可能存在偏离。

（3）由于本基金在投资限制、运作机制和投资策略等方面与广发上海金 ETF 不同，因此本基金具有与广发上海金 ETF 不同的净值增长率。

##### （4）与投资于目标 ETF 相关的风险

本基金为广发上海金 ETF 联接基金，将绝大部分基金资产投资于广发上海金 ETF，投资广发上海金 ETF 潜在的风险因素可能直接或间接成为本基金的风险。与投资广发上海金 ETF 相关的风险包括黄金市场波动风险、基金跟踪偏离风险、基金份额二级市场价格折溢价的风险、本基金交易时间与国际及国内黄金市场交易时间不一致的风险等特有风险，以及第三方机构服务的风险、管理风险、操作风险等其他风险投资者应知悉并关注广发上海金 ETF 招募

说明书等文件中的风险揭示内容。

广发上海金 ETF 及本基金可投资于上海黄金交易所场内黄金现货市场,基金可能面临黄金现货合约投资的相关风险,包括但不限于市场风险、法律风险、政治风险、会计制度风险、税务风险、信用风险、衍生品及相关投资工具的风险等。

广发上海金 ETF 及本基金可投资于上海金集中定价合约,上海金集中定价合约交易实行保证金交易制度,可能在 T+2 日日终合约结算交割时面临交割违约风险。

广发上海金 ETF 及本基金可参与黄金租赁,可能面临交易对手不能按期归还黄金或支付利息的风险。

广发上海金 ETF 及本基金可投资于黄金现货延期交收合约,可能面临如下风险:

黄金现货延期交收合约实行保证金交易制度,若广发上海金 ETF 对黄金现货延期交收合约进行交收,则可能面临实物交收违约风险。

另外,根据《上海黄金交易所风险控制管理办法》,上海黄金交易所所有权根据市场状况和风险管理办法中的有关规定,调整合约保证金比率、单日最大涨跌幅、违约金比率以及延期费率、超期费率等合约参数;有权对出现保证金不足或其它应予强行平仓的情况执行强平,因此广发上海金 ETF 持有的黄金现货延期交收合约可能面临强行平仓风险。

上海金集中定价合约未设置每日价格最大波动限制,而广发上海金 ETF 基金份额的二级市场交易价格有最大波动限制,可能导致广发上海金 ETF 基金份额的二级市场交易价格偏离广发上海金 ETF 基金份额净值的风险。

(5) 业绩比较基准变更的风险

(6) 本基金交易时间与境内外黄金市场交易时间不一致的风险

(7) 投资资产支持证券的风险

## 2、开放式基金的共有风险

(1) 流动性风险;(2) 管理风险;(3) 本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。

## 3、其他风险

### (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。

投资本基金可能遇到的风险主要包括黄金市场波动风险、基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险、与投资于目标 ETF 相关的风险(投资广发上海金 ETF 潜在的风险会直接或间接成为本基金的风险)、本基金交易时间与境内外黄金市场交易时间不一致的风险等本基金特有风险,以及流动性风险、管理风险和其他风险等。

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及定期报告等。

如投资者对基金合同有争议的,争议解决处理方式详见基金合同“争议的处理和适用的法律”部分或相关章节。

## 五、其他资料查询方式

以下资料详见广发基金官方网站 [www.gffunds.com.cn] [客服电话:95105828 或 020-83936999]

(1)《广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金合同》

(2)《广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金托管协议》

(3)《广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金招募说明书》

(4)定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告

- (5) 基金份额净值
- (6) 基金销售机构及联系方式
- (7) 其他重要资料