

天弘上海金交易型开放式证券投资基金发起式联接基金(A类份额)基金产品资料概要(更新)

编制日期: 2024年06月27日

送出日期: 2024年06月28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	天弘上海金ETF发起联接	基金代码	014661
基金简称A	天弘上海金ETF发起联接A	基金代码A	014661
基金管理人	天弘基金管理有限公司	基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
基金合同生效日	2022年03月02日		
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1	陈瑶	开始担任本基金基金经理的日期	2022年03月02日
		证券从业日期	2011年07月01日
基金经理2	沙川	开始担任本基金基金经理的日期	2022年03月02日
		证券从业日期	2011年07月11日
其他	1、商品基金(黄金)。 2、基金合同生效满三年之日(指自然日),若基金规模低于2亿元的,本基金合同应当终止,无需召开基金份额持有人大会审议决定即可按照本基金合同约定的程序进行清算,并不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。《基金合同》生效三年后继续存续的,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,本基金应当按照本基金合同的约定程序进行清算并终止,且无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

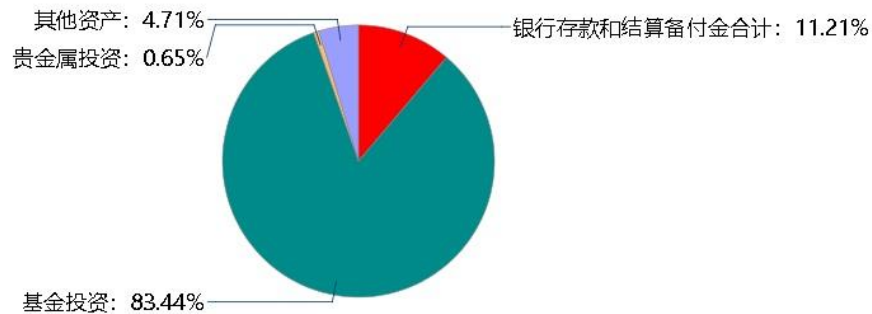
投资目标	通过投资于目标ETF,紧密跟踪上海金集中定价合约表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括目标ETF、上海金集中定价合约及其他在上海黄金交易所上市的黄金现货合约(包括现货实盘合约、现货延期交收合约等)、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、

	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。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。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%；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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF将绝大部分基金财产通过上海金集中定价交易投资于上海黄金交易所的黄金现货合约，以及通过其他交易形式投资于上海黄金交易所上市的黄金现货合约，紧密跟踪上海金集中定价合约表现。本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率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%。本基金投资策略包括：目标ETF投资策略、黄金现货合约投资策略、黄金租赁投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略。
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×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，且本基金目标ETF主要投资对象为黄金现货合约，本基金风险收益特征与目标ETF及其所代表的国内黄金现货品种的风险收益特征相似，不同于股票基金、混合基金、债券基金和货币市场基金。

注：详见《天弘上海金交易型开放式证券投资基金发起式联接基金招募说明书》“基金的投资”章节。

（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

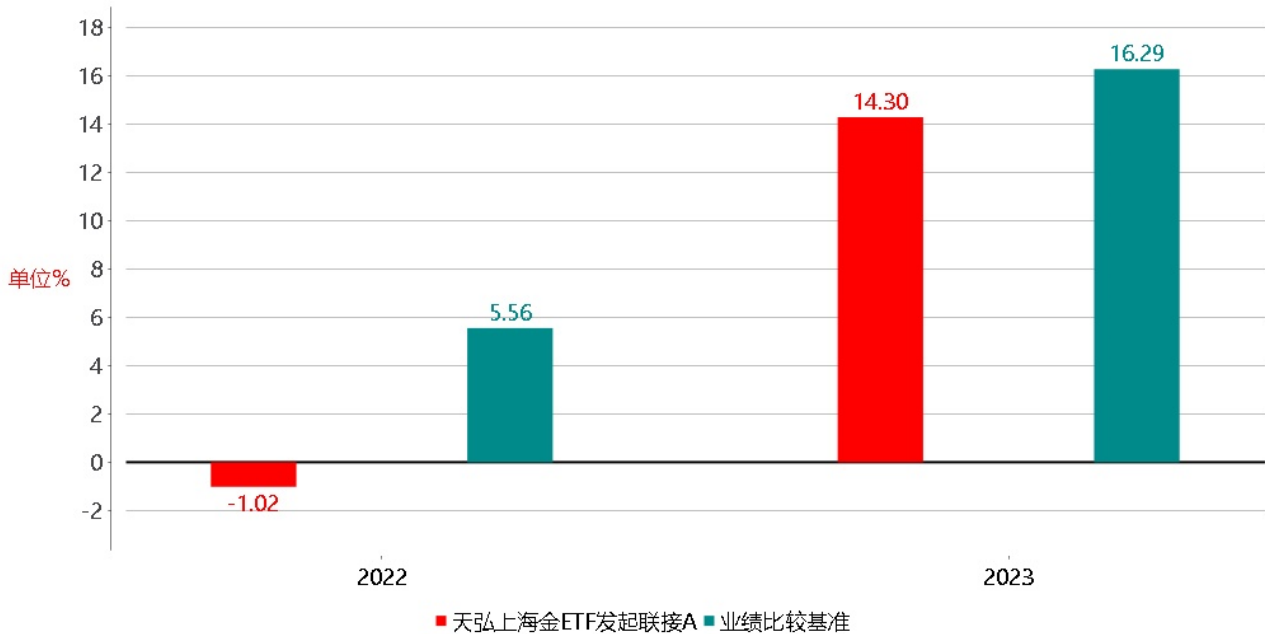
数据截止日期：2024年03月31日



（三）自基金合同生效以来 / 最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基

准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，数据截止日期：2023年12月31日
基金合同生效当年期间的相关数据按实际存续期计算



三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费	M < 500万	1.00%	
	500万 ≤ M	1000元/笔	
赎回费	N < 7天	1.50%	
	7天 ≤ N < 30天	0.30%	
	30天 ≤ N	0.05%	

注：同一交易日投资人可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

(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	收取方
管理费	0.50%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	25,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	50,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	合同约定的其他费用，包括律师费、诉讼费等。	第三方收取方

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和托管费。
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、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。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者申购本基金份额，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）
0.69%

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）目标ETF的风险：本基金属于ETF联接基金，主要投资于目标ETF，因此目标ETF面临的风险（例如黄金价格波动风险、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。在本基金目标ETF未能符合基金备案条件时，本基金将不能设立，面临募集失败的风险。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，如目标ETF通过投资于黄金现货合约，紧密跟踪上海金集中定价合约表现；而本基金采用间接的投资方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对上海金集中定价合约的紧密跟踪；

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。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不得低于基金资产净值的5%，而目标ETF则没有这项规定。

（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，主要影响因素包括：

1) 目标ETF相对业绩比较基准的跟踪误差：本基金主要通过投资于目标ETF追踪业绩比较基准的表现。目标ETF相对于上海黄金交易所上海金集中定价合约（合约代码：SHAU）的午盘基准价格的跟踪误差会影响本基金对业绩比较基准的跟踪误差；

2) 本基金发生管理费和托管费收取等其他导致基金跟踪误差的情形；

（3）业绩比较基准变更的风险：根据基金合同的规定，若未来目标ETF变更业绩比较基准，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在征得基金托管人同意后，变更本基金的业绩比较基准，并报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。如业绩比较基准变更，目标ETF的投资组合可能会有一定调整，以反映新的业绩比较基准的风险收益特征。本基金主要投资于目标ETF，因此将间接承担此项调整带来的风险与成本；

（4）本基金为发起式基金，基金合同生效满三年之日（指自然日），若基金规模低于2亿元的，基金合同应当终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。同时，《基金合同》生效三年后继续存续的，若本基金连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满二

百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，本基金应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会。因此，基金份额持有人还有可能面临基金合同自动终止的风险；

(5) 参与黄金租赁业务的风险：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并取得租赁收入。但黄金现货租赁业务存在交易对手因资信变化、道德风险等而带来的未按时或提前归还黄金现货合约的风险，并进而引致基金资产损失或出现流动性等风险。另外，当本基金需要临时卖出黄金现货合约以支付赎回款项而提前要求交易对手归还黄金现货合约时，也存在交易对手无法提前归还而引起的本基金无法及时支付赎回款项的风险；

(6) 投资黄金现货延期交收合约的风险：本基金可投资黄金现货延期交收合约，黄金现货延期交收合约实行保证金交易制度，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，因此本基金持有的黄金现货延期交收合约可能面临强行平仓风险。

2、其他风险：

市场风险、信用风险、流动性风险、资产支持证券的投资风险、操作风险、管理风险、合规性风险、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、其它风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册/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、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。

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

以下资料详见天弘基金管理有限公司官方网站 [www.thfund.com.cn] [客服电话：95046]

- 《天弘上海金交易型开放式证券投资基金发起式联接基金基金合同》
- 《天弘上海金交易型开放式证券投资基金发起式联接基金托管协议》
- 《天弘上海金交易型开放式证券投资基金发起式联接基金招募说明书》
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料