

# 广发上海金交易型开放式证券投资基金基金产品资料 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	基金代码	518600
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	2020-07-08	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 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 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。法律法规另有规定时，从其规定。		
场内简称	上海金		
扩位简称	上海金 ETF		

## 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上海黄金交易所的上海金集中定价合约及其他黄金现货合约，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	本基金可以投资黄金交易所的黄金现货合约及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金资产可投资的黄金现货合约，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（包括现货实盘合约、现货延期交收合约等）。本基金可从事黄金现货租赁业务。 投资于黄金现货合约和现金之外的基金资产，仅可投资于货币市场工具用于流动性管理，包括：期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在397天以内（含397天）

的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行的认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如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、期货合约、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。

建仓完成后，本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产净值的90%。

### 主要投资策略

本基金通过将绝大部分基金财产投资并持有上海黄金交易所交易的黄金现货合约等黄金品种，来实现跟踪国内黄金现货价格表现的目标。若因特殊情况（如上海黄金交易所市场流动性不足、黄金现货合约存量不足、法律法规禁止或限制等）导致无法获得足够数量的黄金现货合约时，基金管理人将采用合理方法进行替代投资，以达到跟踪上海金集中定价合约价格的目的。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0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。

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。

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。本基金发生流动性问题时，管理人有权提前终止租赁协议、要求交易对手归还黄金现货合约。

投资于黄金现货合约和现金之外的基金资产，仅可投资于货币市场工具用于流动性管理。

### 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

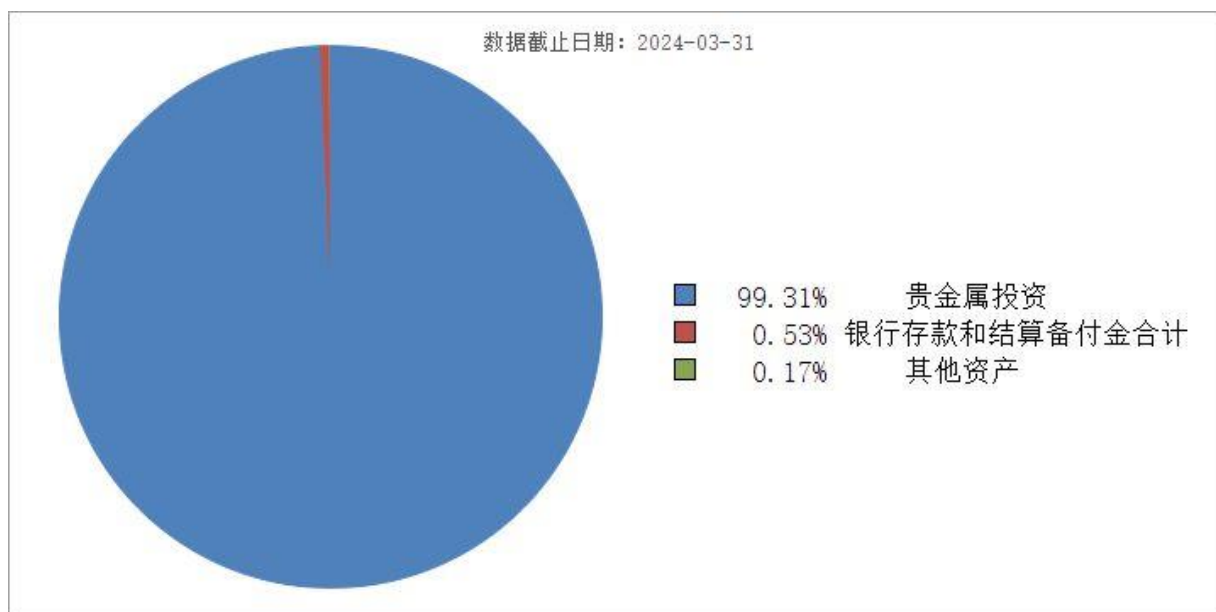
### 风险收益特征

本基金属于黄金ETF，其风险收益特征与国内黄金现货价格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。

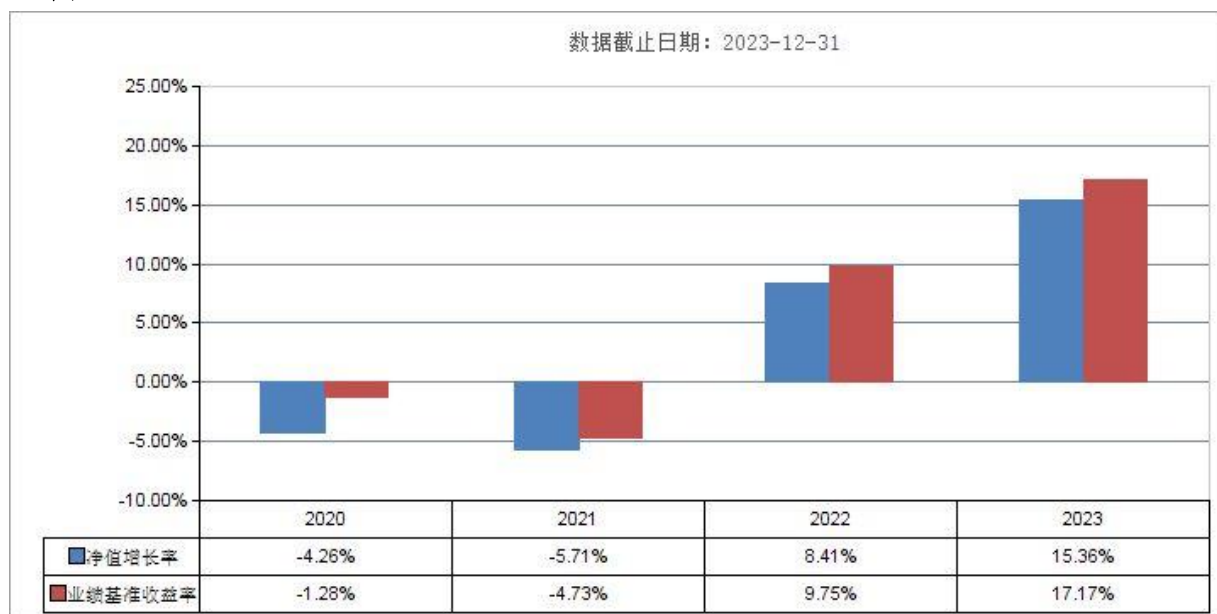
注：详见《广发上海金交易型开放式证券投资基金招募说明书》及其更新文件中“基金的投资”。

## (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

- 1、场内交易费用以证券公司实际收取为准；
- 2、投资者在办理现金申购或赎回时，销售机构可按照不超过 0.5% 的标准收取一定的费用/佣金；投资者在办理黄金现货合约申购或赎回时，销售机构可按照不超过 0.1% 的标准收取一定的费用/佣金。

#### （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	23,000.00	会计师事务所
信息披露费	80,000.00	规定披露报刊
其他费用	《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。  
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）
1.46%

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、黄金价格波动风险

本基金投资于国内黄金市场，基金净值会因为国内黄金现货价格波动等因素产生波动，从而承担黄金价格波动风险。

#### 2、基金资产净值与黄金价格偏离的风险

本基金主要投资于上海黄金交易所挂牌交易的黄金现货合约等黄金品种，追求获得与国内黄金现货价格相似的回报。

本基金投资标的与业绩比较基准的结构可能存在差异。

#### 3、上海黄金交易所场内黄金现货市场投资风险

本基金主要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。

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。

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。

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，若基金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。

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。

#### 4、汇率风险

本基金资产以人民币计价，但本基金持有的主要资产——黄金的国际通用计价货币为美元，虽然本基金持有的黄金资产为上海黄金交易所挂牌交易的黄金现货合约，其交易价格以人民币计价，但是该价格的变化主要受到国际黄金价格的影响，所以人民币与美元之间汇率的变化将会对投资者投资本基金获得的真实收益造成影响。

#### 5、流动性风险评估及流动性风险管理工具

#### 6、通货膨胀风险

#### 7、折溢价风险

本基金的基金份额在上海证券交易所进行交易，而本基金投资的基础资产——黄金现货合约在上海黄金交易所进行交易，而在全球范围内黄金的主要交易市场则位于伦敦和纽约，各交易所开盘、收盘时间以及交易活跃时段均不同。如果本基金基金份额的交易时段与其他市场黄金交易的活跃时段重合或部分重合，则正常情况下基金份额变动将充分反映当时黄

金现货价格波动，若基金交易时段正处于其他市场黄金交易不活跃时段，基金份额净值变动没有良好的参照物，其二级市场价格可能会与黄金价格产生偏离。

本基金份额的二级市场交易同时受到二级市场参与者供需的影响，造成基金份额的二级市场交易价格偏离基金份额净值的风险。尽管本基金设计了一二级市场之间的套利机制，投资者可以通过一二级市场之间的申购、赎回与卖出、买入的套利行为将该风险降至较低水平，但是该机制不能完全规避该风险的存在。

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

8、操作或技术风险

9、退市风险

10、申购、赎回风险

11、基金合同终止的风险

12、第三方机构服务的风险

13、政策变更风险

14、不可抗力风险

15、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

## **(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。

本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产净值的 90%，具有与上海黄金交易所上海金集中定价合约相似的风险收益特征。基金净值会随黄金市场的变化而波动。投资本基金可能遇到的风险包括黄金市场波动风险、基金跟踪偏离风险、基金跟踪偏离风险、基金份额二级市场价格折溢价的风险、本基金交易时间与境内外黄金市场交易时间不一致的风险、不同申购赎回模式下交易和结算规则下交易和结算规则存在差异的风险、基金份额交易规则调整、基金份额交易规则调整的相关风险等特有风险，以及第三方机构服务的风险、管理风险、操作风险、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基金合同》
- (2) 《广发上海金交易型开放式证券投资基金托管协议》
- (3) 《广发上海金交易型开放式证券投资基金招募说明书》
- (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