

# 嘉实上海金交易型开放式证券投资基金发起式联接基金（C类份额）

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月24日

送出日期：2024年6月25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	嘉实上海金 ETF 发起联接	基金代码	016581
下属基金简称	嘉实上海金 ETF 发起联接 C	下属基金交易代码	016582
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2023年3月2日	上市交易所及上市日期	-
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	张钟玉	开始担任本基金基金经理的日期	2023年3月2日
		证券从业日期	2010年5月1日
其他	基金合同生效之日起三年后的对应日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。		

### 二、基金投资与净值表现

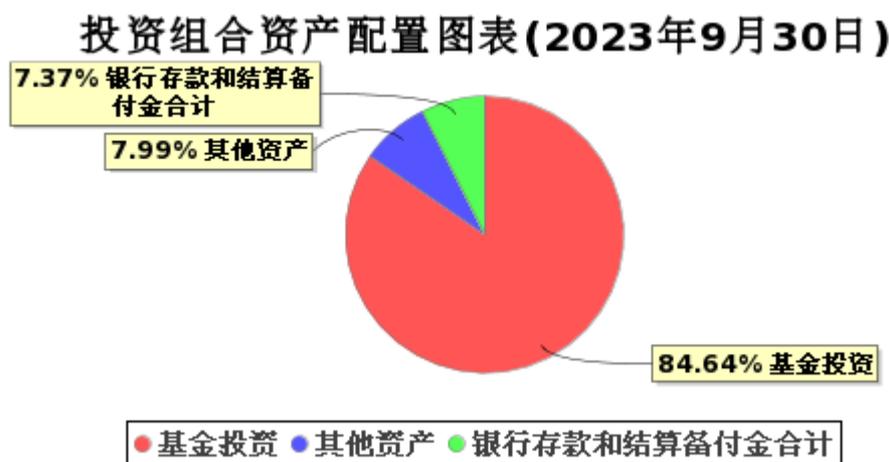
#### （一）投资目标与投资策略

详见《嘉实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》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，力争控制本基金的基金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%。
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（包括黄金现货实盘合约、黄金现货延期交收合约等）、债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具，现金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。 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。

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投资于上海黄金交易所挂牌交易的黄金现货合约（包括上海金集中定价合约、黄金现货实盘合约、黄金现货延期交收合约等）等黄金品种，以实现紧密跟踪上海金价格的目标；本基金主要通过投资于目标ETF来紧密跟踪上海金集中定价合约表现。 具体投资策略包括：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	本基金为嘉实上海金ETF的联接基金，主要通过投资于嘉实上海金ETF来实现对上海金集中定价合约表现的紧密跟踪，因此，本基金的业绩表现与嘉实上海金ETF的表现密切相关。长期来看，本基金具有与嘉实上海金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，不同于股票型基金、混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



## (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：基金的过往业绩不代表未来表现；基金合同生效当年的相关数据根据当年实际存续期计算。

### 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
赎回费	N<7天	1.5%
	N≥7天	0%

#### (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	0.5%	基金管理人和销售机构

托管费	0.1%	基金托管人
销售服务费	0.25%	销售机构
审计费用	30,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	0.00 元	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等可以在基金财产中列支的其他费用，按照国家有关规定和《基金合同》约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。	

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、本基金 C 类份额自 2024 年 4 月 18 日起开展销售服务费优惠活动，优惠后销售服务费率为 0.01%/年。上述优惠活动的具体方案若发生变化，管理人将另行通知或公告。具体请见公司官网刊登的相关公告。

4、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：

嘉实上海金 ETF 发起联接 C

基金运作综合费率（年化）
2.20%

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。本基金 C 类份额目前开展销售服务费优惠活动，基金运作综合费用测算采用《基金合同》约定的销售服务费率测算。

## 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。

一）本基金特有的风险

1、黄金市场波动风险

本基金间接投资于上海黄金交易所挂盘交易的黄金现货合约。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，黄金现货合约价格的变化可能导致基金收益水平的波动，从而产生系统性风险。

2、联接基金的特殊风险

（1）可能具有与目标 ETF 不同的风险收益特征及净值增长率的风险

（2）目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险

（3）由目标 ETF 的联接基金变更为投资黄金现货合约的开放式基金的风险

3、参与黄金租赁业务的风险

4、投资黄金现货延期交收合约的风险

5、本基金投资资产支持证券的相关风险

6、发起式基金的风险及基金自动终止风险

本基金为发起式基金，本基金发起资金提供方对本基金的认购，并不代表对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证，发起资金也并不用于对投资者投资亏损的补偿，投资者及发起资金提供方均自行承担投资风险。本基金发起资金认购的本基金份额持有期限自基金合同生效日起满 3 年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有，届时发起资金提供方有可能赎回认购的基金份额。

基金合同生效之日起三年后的对应日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。因此，投资者将面临基金合同提前终止的不确定性风险。

二）基金管理过程中共有的风险，如市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险和其他风险。

## （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。

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

以下资料详见嘉实基金管理有限公司官方网站：[www.jsfund.cn](http://www.jsfund.cn)；客服电话：400-600-8800。

1、《嘉实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》

《嘉实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》

《嘉实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》

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