

# 天弘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	基金代码	159830
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	2021年07月06日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2021年07月19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	沙川	开始担任本基金基金经理的日期	2021年07月06日
		证券从业日期	2011年07月11日
基金经理2	陈瑶	开始担任本基金基金经理的日期	2021年07月06日
		证券从业日期	2011年07月01日
其他	1、商品基金(黄金)。 2、《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50个工作日出现前述情形的，本基金合同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，同时基金管理人应履行相关的监管报告和信息披露程序。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。 3、场内简称：上海金ETF。		

## 二、基金投资与净值表现

### （一）投资目标与投资策略

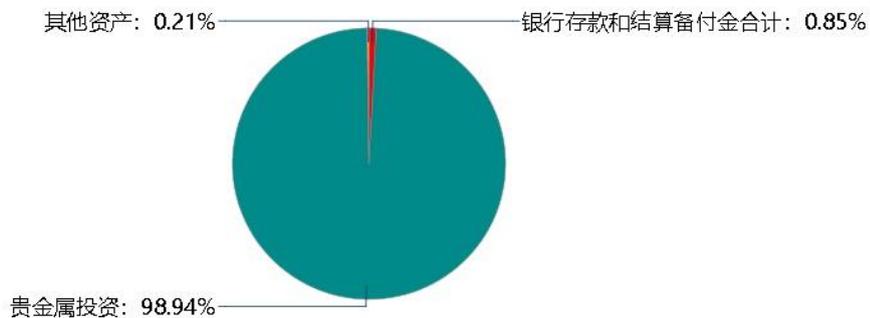
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括黄金现货合约、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于黄金交易所的黄金现货合约包括上海金集中定价合约、黄金现货实盘合约、黄金现货延期交收合约及其他在上海黄金交易所上市的、经中国人民银行批准的合约。本基金主要投资的黄金现货实盘合约AU99.99现货实盘合约，本基金主要投资的黄金现货延期交收合约AU(T+D)。本基金主要投资的黄金现货合约可以根据市场流动性情况的变化进行调整，此调整无须召开基金份额持有人大会。本基金可从事黄金现货租赁业务。本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产的90%。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监

	管机构的规定执行。基于跟踪误差、流动性因素和交易便利程度的考虑，黄金现货合约中，本基金将主要投资于上海金集中定价合约。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法通过上海金集中定价买入现货合约时，基金管理人可投资于AU99.99现货实盘合约和AU(T+D)或其他品种以进行适当替代。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	本基金投资策略包括：黄金现货合约投资策略、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午盘基准价收益率
风险收益特征	本基金追踪上海黄金交易所上海金集中定价合约午盘基准价表现，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。

注：详见《天弘上海金交易型开放式证券投资基金招募说明书》"基金的投资"章节。

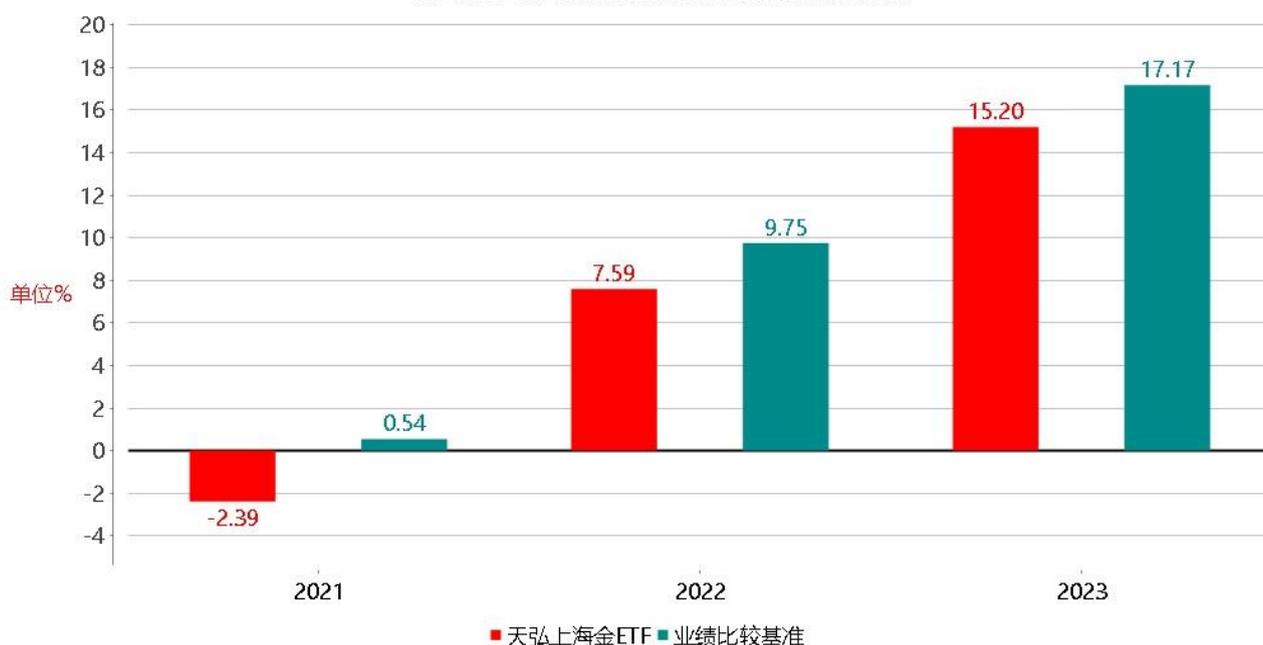
### (二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

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	份额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
申购费			投资人在申购本基金时，申购赎回代理券商可按照不超过0.50%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。
赎回费			投资人在赎回本基金时，申购赎回代理券商可按照不超过0.50%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

注：场内交易费用以证券公司实际收取为准。

#### (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	40,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	100,000.00 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）
--------------

1.57%

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。

本基金的特定风险：

1、投资标的风险：本基金主要投资于国内黄金现货合约，跟踪黄金现货合约价格，黄金价格波动为产品的主要风险。

2、参与黄金现货租赁业务的风险：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兑付赎回对价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兑付赎回对价的风险。

3、黄金现货延期交收合约AU(T+D)的投资风险：本基金在主要投资于上海金集中定价合约的基础上，因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法通过上海金集中定价买入现货合约时，基金管理人可投资于AU(T+D)等黄金现货合约进行适当替代。虽然本基金投资AU(T+D)将遵照严格的比例限制，但仍存在部分不可控风险，如流动性风险、信用风险、交割风险、法律风险和操作等风险。

4、资产支持证券的投资风险：

(1) 与基础资产相关的风险主要包括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) 与资产支持证券相关的风险主要包括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、资产支持证券的流动性风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险。

(3) 其他风险主要包括政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。

5、基金投资者的投资风险：

(1) 本基金跟踪偏离度累计为负的风险：由于本基金投资对象主要为上海黄金交易所的黄金现货合约。基金资产主要以黄金的形式存在，黄金资产不产生任何红利、利息及其他收益，本基金获得超额收益的来源有限，随着基金日常费用的支出，本基金累计超额收益可能长期为负，并且基金存续时间越长，本基金与黄金表现产生负向偏离可能会越来越大。

(2) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险：本基金为交易所交易基金，存在二级市场交易价格（实时市价）与一级市场申购赎回价格（当日基金份额净值）之间偏离的可能性。上海金集中定价合约未设置每日价格最大波动限制，而基金份额净值有涨跌幅限制，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。

(3) 基金份额交易价格折溢价相对股票类ETF可能较高的风险：有效的套利交易会使得ETF交易价格和份额净值之间的偏离较快趋于一致，但由于本基金的二级市场交易场所为深圳证券交易所，而本基金主要投资标的的交易场所为上海黄金交易所，主要由于涨跌停板制度不同、上市交易时间不同、公众假期不同等可能造成本基金折溢价率高于股票类ETF。

(4) 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：由于本基金申购、赎回的开放时间及二级市场交易时间与境内外黄金市场的交易时间并不完全一致，投资人在境外黄金市场开放时间或上海黄金交易所的夜盘交易期间，无法参与本基金的申购、赎回或二级市场

交易。因此，在国际金价出现大幅波动时，本基金的基金份额净值或不能及时反映国际金价市场的变动，基金份额持有人可能因为国际金价的不利变动遭受损失。

(5) 投资人认购或申购失败的风险：

1) 如投资人在提交现券认申购申请时未完成账户备案，或未能根据基金管理人的要求提供符合要求的黄金现货合约，则现券认申购申请失败；

2) 如投资人通过申购赎回代理机构提出现券申购本基金份额时未完成账户备案，或未能提供符合要求的黄金现货合约，或未根据申购赎回清单的要求备足预估现金差额，则现券申购申请失败；如投资人通过基金管理人提出现券申购时未提供符合要求的黄金现货合约，或未能按照基金管理人的要求备足预估现金差额，则现券申购申请失败；

3) 如投资人提出现金申购本基金份额申请时，未能根据现金申购赎回清单的要求备足现金替代或预估现金差额，则现金申购申请失败；

4) 本基金还可能在现券申购赎回清单和现金申购赎回清单中分别设定申购份额上限。对于以现券申购方式提交的申购申请，如果一笔新的被确认成功的申购申请，会使本基金的当日申购份额超过现券申购赎回清单中设定的当日申购份额上限时，该笔申购申请将被拒绝；对于以现金申购方式提交的申购申请，如果一笔新的被确认成功的申购申请，会使本基金的当日申购份额超过现金申购赎回清单中设定的当日申购份额上限时，该笔申购申请将被拒绝；

5) 如果投资人或申购赎回代理机构应付资金不足或出现违约，投资人的申购申请也可能失败。

(6) 投资者赎回失败的风险：

1) 如果投资人在提交现券赎回申请时未完成账户备案，则现券赎回的申请失败；

2) 如投资人通过申购赎回代理机构提出现券赎回份额申请时所持有的符合要求的基金份额不足，或未能根据申购赎回清单的要求备足预估现金差额，则现券赎回申请失败；如投资人通过基金管理人提出现券赎回申请时所持有的符合要求的基金份额不足，或未能根据基金管理人的要求备足预估现金差额，则现券赎回申请失败；

3) 如投资人提出现金赎回申请时所持有的符合要求的基金份额不足，或未能根据申购赎回清单的要求备足预估现金差额，则现金赎回申请失败；

4) 本基金还可能在现券申购赎回清单和现金申购赎回清单中分别设定赎回份额上限。对于以现券赎回方式提交的份额赎回申请，如果一笔新的被确认成功赎回申请，会使本基金当日赎回份额超过现券申购赎回清单中设定的当日赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝；对于以现金赎回方式提交的份额赎回申请，如果一笔新的被确认成功的份额赎回申请，会使本基金当日赎回份额超过现金申购赎回清单中设定的当日赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝；

5) 随着市场环境的变动，基金管理人有可能调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

(7) 不同申购赎回模式下交易和结算规则存在差异的风险：本基金的申赎模式分为现券申赎、现金申赎，根据申购、赎回对价的不同，本基金的申赎分别适用不同的申购、赎回办法。上述几种申赎模式下，本基金的申购赎回开放日、开放时间，以及基金份额清算、交收所遵循的登记结算规则均有差异。

(8) 基金份额交易规则调整的相关风险：因深圳证券交易所、登记结算机构及上海黄金交易所等服务机构可能就本基金基金份额的交易、结算等相关规则进行调整，本基金基金份额申购、赎回的登记交收规则或上市交易的交易规则可能因此而发生变化。基金管理人届时将根据相关服务机构的调整后的业务规则及本基金的运作需要，适时调整本基金各申赎模式的交易、结算规则。本基金基金份额交易、结算规则的调整或将涉及相关业务办理时间及销售机构的调整，可能与投资人的交易习惯有一定差异。

6、基金管理人的风险：本基金管理人所面临的风险主要为履行申购赎回约定的风险。现券赎回风险，指本基金现券赎回时，由于本基金投资组合中的黄金现货合约数量大幅减少，甚至接近于0，从而影响基金正常运作的风险。

7、与ETF运作相关的风险：主要包括第三方机构服务风险、参考基金份额参考净值（IOPV）决策和IOPV计算错误的风险、二级市场流动性不足风险、操作风险、交收失败风险、技术风险、管理风险、不可抗力等。

8、流动性风险：本基金的流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回对价的风险。

## （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基金合同》
- 《天弘上海金交易型开放式证券投资基金托管协议》
- 《天弘上海金交易型开放式证券投资基金招募说明书》
- 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