

大成上海金交易型开放式证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2021年12月24日

送出日期：2021年12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	大成上海金 ETF	基金代码	159833
基金管理人	大成基金管理有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
上市交易所及上市日期	深圳证券交易所		
基金合同生效日	-		
基金类型	其他类型	交易币种	人民币
运作方式	交易型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	李绍	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2000年4月1日
其他	场内简称：上海金基金 ETF。 本基金基金类型为商品基金。 《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 50 个工作日出现前述情形的，基金合同应当终止，无需召开基金份额持有人大会。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见《大成上海金交易型开放式证券投资基金招募说明书》第十一部分“基金的投资”。

投资目标	紧密跟踪上海金集中定价合约 SHAU 的价格表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资范围	本基金的投资范围包括上海黄金交易所挂牌交易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。本基金可投资的黄金现货合约（包括上海金集中定价合约、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借业务。 本基金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。 基金的投资组合比例为：本基金建仓完成后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。
主要投资策略	<p>1、黄金现货合约的投资策略</p> <p>(1) 上海金集中定价合约投资策略</p> <p>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。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%。一般情况下，若投资人进行现金申购，本基金将以收到的替代金额买入上海金集中定价合约；若投资人进行现金赎回，本基金将通过卖出上海金集中定价合约支付投资人的赎回相关对价。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。</p> <p>(2) 其他黄金现货合约投资策略</p> <p>本基金主要采取被动式管理策略，主要投资于上海黄金交易所黄金现货合约。一般情况下，基金管理人将通过上海金集中定价合约 SHAU 的方式买卖黄金现货合约，但发生特殊情况时（包括但不限于上海金集中定价合约 SHAU 交割违约等），基金管理人可投资于 AU99.99 和 AU (T+D) 或其他品种以进行适当替代。</p> <p>本基金参与黄金现货延期交收合约 AU (T+D) 投资仅用于风险管理或提高资产配置效率。在正常市场情况下，本基金的风险管理目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。当基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围时，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>2、流动性管理策略</p> <p>管理人将综合考虑市场环境、申购赎回情况等因素动态确定组合适宜的现金比例，其余资产将投资于货币市场工具或法律法规允许的其他投资工具，以增强组合内现金部位的收益。本基金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。</p> <p>3、黄金租借业务</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，取得租借收入。本基金的黄金租借对手方仅限于上海黄金交易所金融类会员中的银行及分类评级在 A 类以上的证券公司。本基金发生流动性问题时，管理人有权提前终止租借协议、要求交易对手归还黄金现货合约。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：上海黄金交易所上海金集中定价合约(合约代码:SHAU)午盘基准价格收益率
风险收益特征	本基金跟踪上海金集中定价合约的价格表现，具有与上海黄金交易所上海金集中定价合约 SHAU 相似的风险收益特征。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

本基金合同未生效。

(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

本基金合同未生效。

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
认购费	S<50 万	0.5%
	50 万≤S<100 万	0.3%
	S≥100 万	1,000 元/笔

注:投资人参与本基金基金份额的现金申购、赎回,申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金。

(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
管理费	0.5%
托管费	0.1%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所费、律师费、仲裁费和诉讼费;基金份额持有人大会费用;基金因黄金现货合约交易、结算、仓储以及在投资人申购、赎回基金份额过程中因黄金现货合约过户所承担的费用(包括但不限于交易手续费、租借手续费、延期补偿费、过户费、仓储费、运保费等相关费用及其他类似性质的费用);基金的黄金租借业务相关费用;基金的银行汇划费用;基金收益分配中发生的费用;基金的开户费用;账户维护费用;基金上市费及年费;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。

注:本基金交易证券等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

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。

本基金特有风险:

1、黄金市场波动风险

本基金主要投资于在上海黄金交易所挂盘的黄金现货合约。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,产生系统性风险。

影响黄金现货合约价格的因素包括但不限于:

(1) 影响黄金供求关系的因素,包括黄金生产、加工商库存的变动或对冲行为、各国央行购买和出售黄金储备的行为,以及主要黄金生产国黄金生产成本的变动等因素;

(2) 投资者对通胀水平的预期;

(3) 主要经济体的利率水平及汇率水平的变动;

(4) 各国央行、对冲基金、商品基金等机构投资者的投资与交易活动;

(5) 全球或地区政治、经济、金融局势及货币体系的变化。

2、基金跟踪偏离风险

由于各种因素的影响,本基金的表现与业绩比较基准表现之间可能产生差异,即跟踪偏离风险。

3、参与黄金租借业务的风险

本基金可以参与黄金现货租借业务。为降低基金费用对跟踪偏离度与跟踪误差的影响,在法律法规允许的前提下,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,取得租借收入,并要求对方按时或提前归还黄金现货合约。该业务可能存在赎回风险及违约风险。赎回风险方面,进行黄金租借业务后,若出现连续赎回或大额赎回,可能导致本基金持有的黄金现货实盘合约数量不足,申购赎回授权参与人面

临无法及时赎回的风险。参与黄金租借业务，可能出现交易对手不能按期归还黄金或支付利息的风险。

- 4、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险
- 5、投资黄金现货延期交收合约的风险
- 6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险
- 7、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
- 8、投资人申购、赎回申请失败的风险
- 9、无法赎回基金份额的风险
- 10、基金份额赎回对价的变现风险
- 11、现金申购赎回的价格风险
- 12、账户备案差错风险
- 13、业务规则变更的风险
- 14、退市风险
- 15、不同申购赎回模式下交易和结算规则存在差异的风险
- 16、申购赎回清单差错风险
- 17、基金合同终止的风险
- 18、第三方机构服务的风险

(二) 重要提示

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。

大成上海金交易型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会【2020】3030 号文予以注册。

中国证监会对本基金募集的注册或核准，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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.dcfund.com.cn]客服电话[4008885558]

1. 大成上海金交易型开放式证券投资基金基金合同、大成上海金交易型开放式证券投资基金托管协议、大成上海金交易型开放式证券投资基金招募说明书
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