

富国上海金交易型开放式证券投资基金联接基金（C类份额）基金产品资料概要更新

2024年06月04日（信息截至：2024年06月03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	富国上海金 ETF 联接	基金代码	009504
份额简称	富国上海金 ETF 联接 C	份额代码	009505
基金管理人	富国基金管理有限公司	基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
基金合同生效日	2020年07月24日	基金类型	其他类型
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	人民币		
基金经理	王乐乐	任职日期	2020年07月24日
		证券从业日期	2010年06月01日

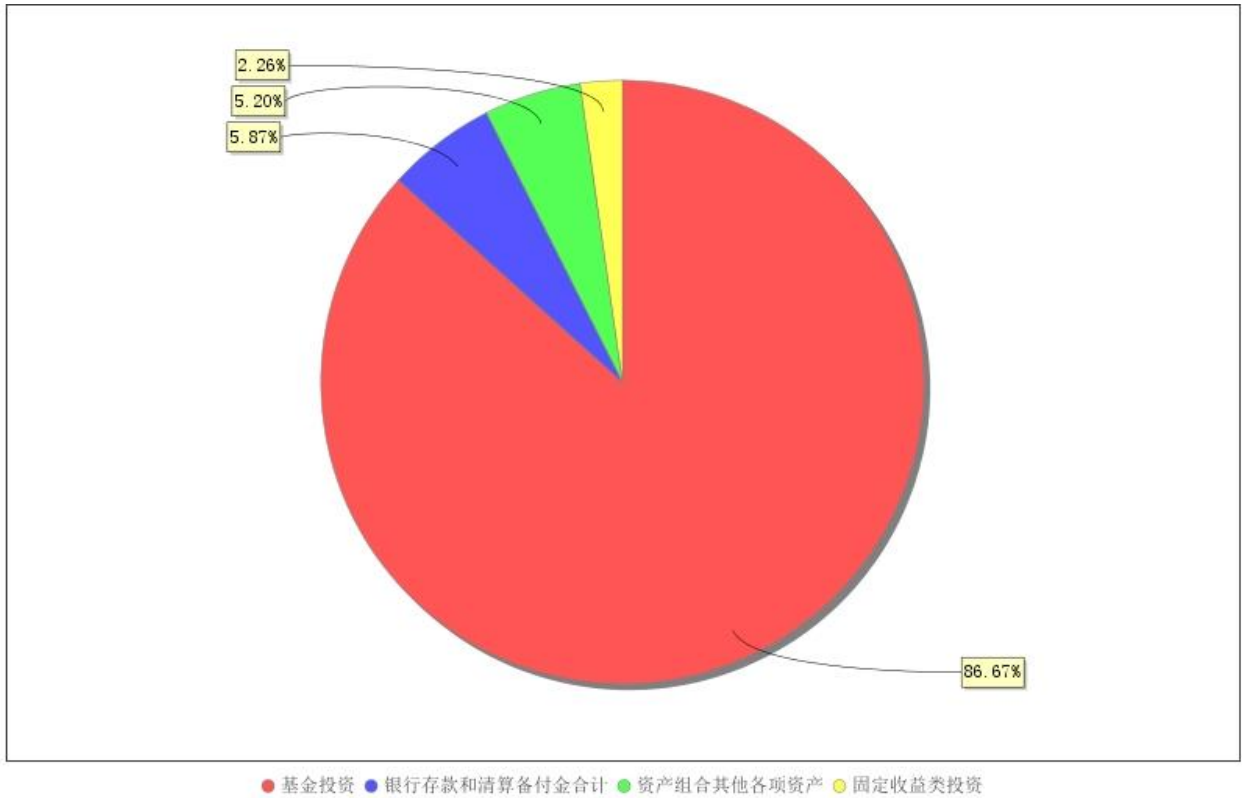
二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪上海金价格，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资范围	本基金的投资范围主要为目标 ETF 基金份额和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。基金可少量投资于债券（国家债券、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票等权益类资产。本基金投资于目标 ETF 的比例不得低于基金资产净值的 90%。
主要投资策略	本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便投资者通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的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%。本基金具体的资产配置策略、目标 ETF 投资策略、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详见法律文件。
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）午盘基准价格收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 主要投资对象为黄金现货合约，故本基金风险收益特征与目标 ETF 相似，即与国内黄金资产的风险收益特征相似，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。

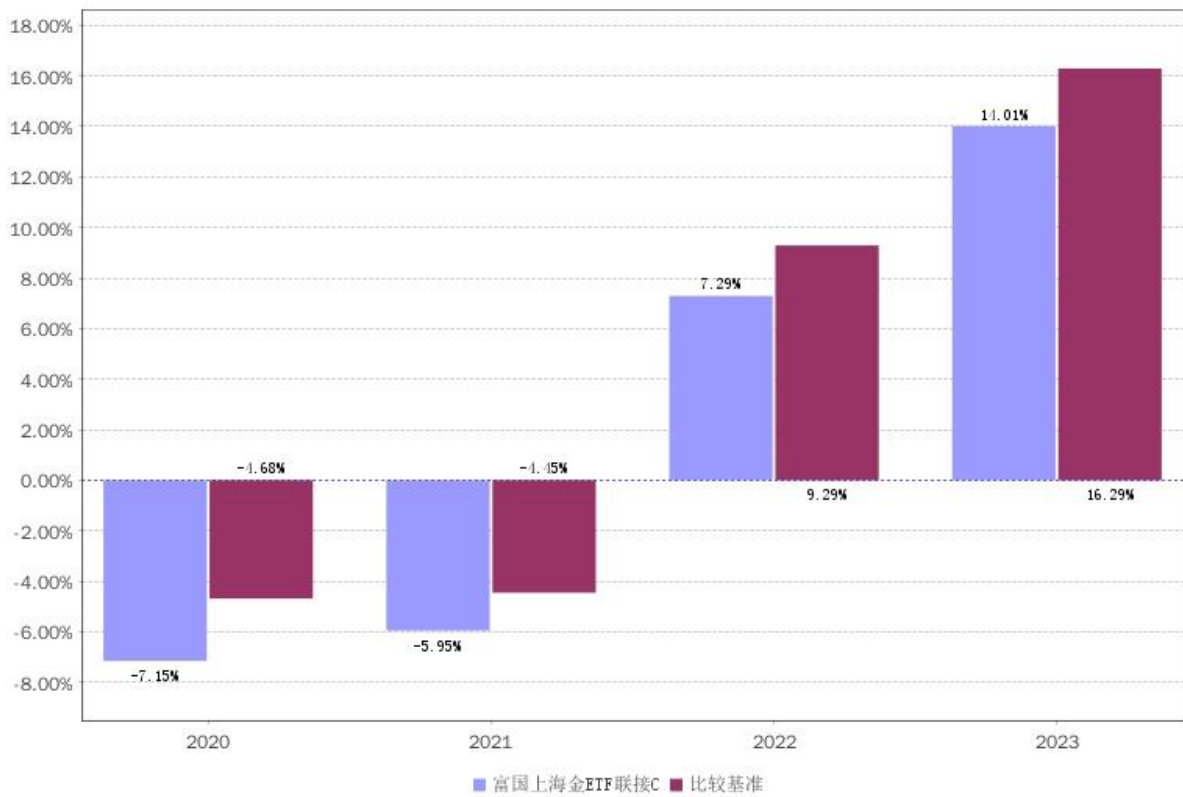
注：详情请阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节的相关内容。

（二）投资组合资产配置图表



注：截止日期 2024 年 03 月 31 日。

(三) 自基金合同生效以来基金（C 份额）每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金合同生效日 2020 年 07 月 24 日。业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。基金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

费用类型	金额 (M) / 持有期限 (N)	费率 (普通客户)	费率 (特定客户)
赎回费	N < 7 天		1.5%
	7 ≤ N < 30 天		0.1%
	N ≥ 30 天		0

注：本基金 C 类基金份额不收取申购费用，赎回费用在投资者赎回基金过程中收取。

(二) 基金运作相关费用

费用类别	年费率/收费方式	收取方
管理费	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
销售服务费	0.35%	销售机构
审计费用	38,000.00 元/年	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元/年	规定披露报刊

注：以上费用将从基金资产中扣除；基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费、托管费。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。审计费用、信息披露费为基金整体承担的年费用金额，非单个份额类别费用。年费用金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。除上述费用外的其他运作费用，详见《招募说明书》中的“基金费用与税收”章节。

(三) 基金运作综合费用测算

基金运作综合费率（年化）
1.06%

注：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上表所示。基金管理费率、托管费率、销售服务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。

本基金投资中的风险包括：投资黄金现货延期交收合约的风险，参与黄金租赁业务的风险，证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，基金投资对象与投资策略引致的特有风险等。

本基金的特定风险包括：

1、黄金价格波动风险

本基金间接投资于上海黄金交易所挂牌交易的黄金现货合约。黄金价格波动为本基金的主要风险。其中影响黄金价格的主要因素包括但不限于：（1）黄金的供给和需求。（2）投资者对通胀水平的预期。（3）全球经济体的利率水平和汇率水平的变化。（4）全球或地区政治、经济、金融环境的变化。（5）各国央行、大型对冲基金和商品基金的投资与交易变化。

2、本基金为目标 ETF 联接基金，投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，因此，本基金将面临例如目标 ETF 的管理风险与操作风险、目标 ETF 特有风险（包括基金份额二级市场交

易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、申购/赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、第三方机构服务的风险及投资特定品种的投资风险等)、目标 ETF 的技术风险等风险。而本基金作为普通的开放式基金, 仍需保留不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。会导致本基金与标指数之间的跟踪误差。另外, 本基金作为开放式基金, 需在每个开放日接受投资者的申购或赎回申请, 当发生大额申购和赎回时, 将可能对基金净值产生一定冲击。

3、参与黄金租赁业务的风险

本基金可以参与黄金现货租赁业务。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, 取得租赁收入, 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。

4、投资黄金现货延期交收合约的风险

本基金可投资于黄金现货延期交收合约, 以期降低跟踪误差水平。在投资黄金现货延期交收合约时, 主要存在延期费拖累、保证金不足和交收违约等风险。

5、本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。

除以上风险外, 本基金还可能存在基金财产投资运营过程增值税的特有风险。

(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。

与本基金或基金合同相关的一切争议将提交位于上海的上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁, 仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均具有约束力。

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、定期公告等披露文件。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站(www.fullgoal.com.cn), 客户服务热线: 95105686, 4008880688 (全国统一, 免长途话费)

- 1、基金合同、托管协议、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