

博时黄金交易型开放式证券投资基金 招募说明书

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

【重要提示】

1、本基金根据 2013 年 7 月 31 日中国证券监督管理委员会《关于核准博时黄金交易型开放式证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可[2013]1026 号）和 2014 年 7 月 29 日《关于博时黄金交易型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2014]903 号）文进行募集。

2、本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

3、本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产的 90%，具有与上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约相似的风险收益特征。

本基金净值会随黄金市场的变化而波动。投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购赎回）、买卖基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。

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、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、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存在差异的风险、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、交收失败风险、技术风险、不可抗力风险等。

基金管理人提醒投资者关于基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

4、投资人进行网上、网下现金认购以及在二级市场交易时，需具有深圳证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户，但证券投资基金账户不可用于本基金份额的申购和赎回；投资人以黄金现货实盘合约认购、申购或赎回本基金基金份额时，需同时具有深圳证券交易所 A 股账户和上海黄金交易所黄金账户（以下简称“黄金账户”），并根据上海黄金交易所的相关规定，事先通过销售机构进行账户备案。未进行账户备案的投资人以黄金现货实盘合约提交认购或申购申请将作失败处理。

5、本基金提供场内申赎与场外申赎两类申赎场所，基金管理人可向投资人提供场内现券申购赎回、场内现金申购赎回、场外现券申购赎回、及场外现金申购赎回等多种申购、赎回方式，不同申购、赎回方式的开放日与开放时间、清算交收及登记结算规则或有差异。其中。

如在本基金开放场内现券申购赎回业务后，仍未开立、或无法开立黄金账户但采取现金认购方式获得本基金基金份额的投资人仅可通过二级市场卖出其认购的本基金基金份额。如

届时本基金同时开放场外、或场内现金申购赎回业务，上述无法开立黄金账户的投资人亦可以现金赎回方式赎回其所持有的本基金基金份额。

请投资人仔细阅读《基金合同》和《招募说明书》关于本基金场外现券申购赎回、场内现券申购赎回、场外现金申购赎回、场内现金申购赎回等规则的说明，并留意本基金各类申购、赎回业务的开放时间。

6、投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及申购、赎回对价的交收方式已经认可。

7、在目前结算规则下，投资人当日申购的基金份额在完成清算交收后方可卖出和赎回；当日买入的基金份额，基金份额与资金完成交收后可以卖出或赎回。即：

(1) 在本基金开通场外现券申赎业务，即以黄金现货实盘合约实时过户的方式办理申购、赎回业务前，投资人 T 日以场外现券申购方式申购的本基金份额，T+2 日可以赎回或卖出；投资人 T 日以场外现券赎回方式赎回本基金份额，T+1 日日终可完成黄金现货实盘合约的过户；在本基金开通场外现金申赎业务时，投资人 T 日以现金方式申购的本基金份额，T+1 日可卖出和赎回；投资人 T 日买入的本基金份额，T+1 日可以现金方式赎回或卖出。

(2) 根据本基金目前提供的场内现金赎回、场外现金赎回的结算交收规则，当投资人赎回申请被登记结算结构确认后，被赎回的基金份额即被记减，但此时投资人尚未收到赎回替代款。

(3) 在本基金开通场内现券申赎业务，即以黄金现货实盘合约实时过户的方式办理申购、赎回业务后，本基金份额的申赎、结算交收、交易规则等根据届时深圳证券交易所、登记结算机构及上海黄金交易所等相关服务机构的相关规定进行调整并由基金管理人公告。若前述服务机构就本基金基金份额的申赎、结算交收、交易等相关规则进行调整，基金管理人或将调整本基金相关业务的具体办理时间及销售机构，请投资人关注基金管理人及相关服务机构的相关公告。

8、本基金追踪黄金现货实盘合约价格，但不等同于实物黄金，投资者赎回基金份额时得到相应价值的上海黄金交易所的黄金现货实盘合约及现金差额，无法直接取得实物黄金。

9、基金不同于银行储蓄与债券，基金投资人有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

10、基金的过往业绩并不预示其未来表现。

11、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。

目 录

第一部分	绪言.....	1
第二部分	释义.....	2
第三部分	基金管理人.....	6
第四部分	基金托管人.....	16
第五部分	相关服务机构.....	18
第六部分	基金的募集.....	20
第七部分	基金的备案.....	25
第八部分	基金份额折算与变更登记.....	26
第九部分	基金份额的交易.....	27
第十部分	基金份额的申购与赎回.....	29
第十一部分	基金的投资.....	40
第十三部分	基金资产的估值.....	46
第十四部分	基金的收益与分配.....	48
第十五部分	基金费用与税收.....	50
第十五部分	基金费用与税收.....	50
第十六部分	基金的会计与审计.....	52
第十七部分	基金的信息披露.....	53
第十八部分	风险揭示.....	56
第十九部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	61
第二十部分	基金合同的内容摘要.....	63
第二十一部分	基金托管协议的内容摘要.....	75
第二十二部分	对基金份额持有人的服务.....	82
第二十三部分	招募说明书存放及查阅方式.....	83
第二十四部分	备查文件.....	84

第一部分 绪言

《博时黄金交易型开放式证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作管理办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售管理办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）以及《博时黄金交易型开放式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

博时黄金交易型开放式证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。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，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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。

第二部分 释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：	指博时黄金交易型开放式证券投资基金；
基金合同：	指《博时黄金交易型开放式证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充；
招募说明书或本招募说明书：	指《博时黄金交易型开放式证券投资基金招募说明书》及其定期更新；
托管协议：	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《博时黄金交易型开放式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充；
业务规则：	指《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》；
发售公告：	指《博时黄金交易型开放式证券投资基金份额发售公告》；
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会；
中国银监会：	指中国银行业监督管理委员会；
《基金法》：	指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及立法机关对其不时做出的修订；
《销售办法》：	指中国证监会 2011 年 6 月 9 日颁布，同年 10 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及其不时做出的修订；
《运作办法》：	指中国证监会 2004 年 6 月 29 日颁布，同年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金运作管理办法》及其不时做出的修订；
《信息披露办法》：	指中国证监会 2004 年 6 月 8 日颁布，同年 7 月 1 日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及其不时做出的修订；
元：	指人民币元；
基金合同当事人：	指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人；
基金管理人：	指博时基金管理有限公司；
基金托管人：	指中国银行股份有限公司；
基金份额持有人：	指依照法律法规、招募说明书和基金合同合法取得基金份额的投资者；
登记结算业务：	指《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务；
登记结算机构：	指中国证券登记结算有限责任公司；
上海黄金交易所、黄金交易所或金交所：	均指上海黄金交易所，即经国务院批准，由中国人民银行组建，在国家工商行政管理总局登记注册的，目前中国唯一合

	法从事贵金属交易的国家级市场，遵循公开、公平、公正和诚实信用的原则组织黄金交易，不以营利为目的，实行自律性管理的社团法人；
投资者：	指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于开放式证券投资基金的自然人；
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织；
合格境外机构投资者：	指符合法律法规规定，经中国证监会批准可以投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者；
基金份额持有人大会：	指按照基金合同第九部分之规定召集、召开并由基金份额持有人或其合法的代理人进行表决的会议；
基金募集期：	指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；
基金合同生效日：	指募集结束，基金募集的基金份额总额、募集金额和基金份额持有人人数符合相关法律法规和基金合同规定的，基金管理人依据《基金法》向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；
存续期：	指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；
工作日：	指深圳证券交易所的正常交易日；
发售：	指在基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金基金份额的行为；
认购：	指在基金募集期内，投资者按照基金合同和招募说明书的规定申请购买本基金基金份额的行为；
申购：	指基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为；
赎回：	指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件申请将其持有的本基金基金份额兑换为基金合同约定的对价资产的行为；
申购、赎回清单：	指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件；
申购对价：	指投资者申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
赎回对价：	指投资者赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；
组合证券：	指在黄金交易所上市交易的黄金（Au）品种，为标的指数对应的黄金现货合约或者基金管理人指定的黄金现货合约；

黄金现货合约	指黄金现货实盘合约、黄金现货延期交收合约以及《上海黄金交易所现货交易规则》（及其不时修订）规定的在黄金交易所其他黄金现货挂盘合约；
黄金现货实盘合约	指依据《上海黄金交易所现货交易规则》（及其不时修订）采用现货实盘交易的黄金交易所挂盘合约；
现金差额：	指最小申购、赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购、赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资者申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算；
现金替代：	指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金；
最小申购、赎回单位：	指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资者申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍；
基金份额参考净值：	指基金管理人或管理人委托的第三方在交易时间内根据基金管理人提供的申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称 IOPV；
场内申赎	指投资者通过上海黄金交易所会员采用现券或通过深圳证券交易所会员采用现金申购、赎回本基金份额的方式；
场外申赎	指投资人通过基金管理人直销等场外申赎代理机构采用现券或现金申购、赎回本基金份额的方式；
现金申赎	指投资者通过现金申购、赎回本基金基金份额的方式；
现券申赎	指投资者通过黄金现货实盘合约申购、赎回本基金基金份额的方式；
预估现金部分：	指为便于计算基金份额参考净值及申赎代理机构预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算并公布的现金数额；
黄金成色：	黄金及其制品的纯度叫作“成色”，表示金属货币、金银条块或饰品的金属纯度，一般以千分比表示，也可用百分比表示。如成色标准为 995、9995 和 9999 分别表示纯度为 995‰、999.5‰和 999.9‰；
收益评价日：	指基金管理人计算本基金累计收益率与标的指数累计收益率差额之日；
标的指数累计收益率：	指收益评价日的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去 100%（期间如发生基金份额折算或拆分、合并，则以基金份额折算或拆分、合并日为初始日重新计算）；
基金累计收益率：	指收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值的收盘价之比减去 100%（期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算，如本基金实施份额拆分、合并，将按经拆分、合并调整后的基金份额折算日的基金份额净值来计算基金累计收益率）；
联接基金：	指将绝大部分基金财产投资于博时黄金交易型开放式证券投资基金（目标 ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金；

发售代理机构:	指基金管理人指定的,在本基金认购期间代理本基金发售业务的机构;
申购赎回代理机构:	指基金管理人指定的、符合特定资格的、在基金合同生效后代理办理本基金申购、赎回业务的销售机构
直销机构:	指博时基金管理有限公司;
代销机构:	指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的、具有基金代销业务资格的机构;
销售机构:	指基金管理人及本基金代销机构;
基金销售网点:	指基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点;
指定媒体:	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站;
深圳证券账户:	指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户(简称“A股账户”)或证券投资基金账户(简称“基金账户”),投资者参与本基金在深圳证券交易所现金认购、网下现金认购、黄金现券认购、上市交易以及申购、赎回等业务时需具有深圳证券账户;
黄金交易编码:	指上海黄金交易所根据《上海黄金交易所现货交易规则》为客户分配的黄金交易编码;
开放日:	指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期;
T日:	指销售机构在规定时间内受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期;
T+n日:	指T日起(不包括T日)的第n个工作日;
基金利润:	指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额;
基金资产总值:	基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和;
基金资产净值:	指基金资产总值减去基金负债后的价值;
基金份额净值:	指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数后得出的基金份额的资产净值;
法律法规:	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件以及对其做出的不时修改和补充;
不可抗力:	指无法预见、无法避免、无法克服的任何事件和因素。

第三部分 基金管理人

一、基金管理人基本情况

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

法定代表人：杨鹤

成立时间：1998 年 7 月 13 日

注册资本：2.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：沈康

联系电话：0755-83169999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；璟安股权投资有限公司，持有股份 6%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；上海丰益股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

公司设立了投资决策委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设三大总部和十二个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部、市场销售总部以及宏观策略部、交易部、产品规划部、互联网金融部、董事长办公室、总裁办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

权益投资总部负责公司所管理资产的权益投资管理及相关工作。权益投资总部下设股票投资部（含各投资风格小组）、特定资产管理部、研究部。股票投资部负责进行股票选择和组合管理。特定资产管理部负责特定资产的管理和客户咨询服务。研究部负责完成对宏观经济、投资策略、行业上市公司及市场的研究。固定收益总部负责公司所管理资产的固定收益投资管理及相关工作。固定收益总部下设现金管理组、公募基金组、专户组、国际组和研究组，分别负责各类固定收益资产的研究和投资工作。市场销售总部负责公司全国范围内的客户、销售和服务工作。市场销售总部下设机构与零售两大业务线和营销服务部。机构业务线含战略客户部、机构-上海、机构-南方三大区域和养老金部、券商业务部两个部门。战略客户部负责北方地区由国资委和财政部直接管辖企业以及该区域机构客户的销售与服务工作。机构-上海和机构-南方分别主要负责华东地区、华南地区以及其他指定区域的机构客户销售与服务工作。养老金业务部负责养老金业务的研究、拓展和服务等工作。券商业务部负责券商渠道的开拓和销售服务。零售业务线含零售-北京、零售-上海、零售-南方三大区域，以及

客户服务中心。其中，零售三大区域负责公司全国范围内零售客户的渠道销售和服务。客户服务中心负责零售客户的服务和咨询工作。营销服务部负责营销策划、总行渠道维护和销售支持等工作。

宏观策略部负责为投委会审定资产配置计划提供宏观研究和策略研究支持。交易部负责执行基金经理的交易指令并进行交易分析和交易监督。产品规划部负责新产品设计、新产品报批、主管部门沟通维护、产品维护以及年金方案设计等工作。互联网金融部负责公司互联网金融战略规划的设计和实施，公司互联网金融的平台建设、业务拓展和客户运营，推动公司相关业务在互联网平台的整合与创新。董事长办公室专门负责股东会、董事会、监事会及董事会各专业委员会各项会务工作；股东关系管理与董事、监事的联络、沟通及服务；基金行业政策、公司治理、战略发展研究；与公司治理及发展战略等相关的重大信息披露管理；政府公共关系管理；党务工作；博时慈善基金会的管理及运营等。总裁办公室负责公司的战略规划研究、行政后勤支持、会议及文件管理、公司文化建设、品牌传播、对外媒体宣传、外事活动管理、档案管理及工会工作等。人力资源部负责公司的人员招聘、培训发展、薪酬福利、绩效评估、员工沟通、人力资源信息管理工作。财务部负责公司预算管理、财务核算、成本控制、财务分析等工作。信息技术部负责信息系统开发、网络运行及维护、IT 系统安全及数据备份等工作。基金运作部负责基金会计和基金注册登记等业务。风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。监察法律部负责对公司投资决策、基金运作、内部管理、制度执行等方面进行监察，并向公司管理层和有关机构提供独立、客观、公正的意见和建议。

公司另设有北京分公司、上海分公司、沈阳分公司、郑州分公司和成都分公司，分别负责对驻京、沪、沈阳、郑州和成都人员日常行政管理和对赴京、沪、沈阳、郑州和成都处理公务人员给予协助。此外，还设有全资子公司：博时资本管理有限公司和境外子公司：博时基金（国际）有限公司。

截止到 2014 年 6 月 30 日，公司总人数 389 人，其中研究员和基金经理超过 94%拥有硕士及以上学位。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

二、主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

杨鶄女士，硕士，董事长，深圳市五届人大代表，中国红十字会第九届理事会常务理事。1983 年起历任中国银行国际金融研究所助理研究员，香港中银集团经济研究部副研究员，招商银行证券部总经理，深圳中大投资管理公司常务副总经理，长盛基金管理公司副总经理，中信基金管理公司总经理，招商银行独立董事，招商证券股份有限公司董事、总裁。2008

年7月起，任博时基金管理有限公司董事会董事长。现任公司董事长，兼博时基金（国际）有限公司董事会主席、博时资本管理有限公司董事长，招商证券股份有限公司董事。

桑自国先生，博士后，副董事长。1993年起历任山东证券投资银行部副总经理、副总经理、泰安营业部副总经理，中经信投资公司总经理助理、中经证券有限公司筹备组组长，永汇信用担保有限公司董事长、总经理，中国华融资产管理公司投资事业部总经理助理、副总经理。2011年5月进入中国长城资产管理公司，历任投资投行事业部副总经理、总经理。2011年7月起，任博时基金管理有限公司董事会董事。2013年8月起，任博时基金管理有限公司董事会副董事长。

吴姚东先生，博士，北京大学光华管理学院EMBA，董事。1990年至1996年曾任职于湖北省鄂城钢铁厂，历任团委干部、下属合资公司副总经理等职。2002年进入招商证券股份有限公司，历任国际业务部分析师、招商证券武汉营业部副总经理（主持工作）、招商证券（香港）公司副总经理（主持工作）兼国际业务部董事、总裁办公室总经理、董事总经理，公司总裁助理。2013年5月加入博时基金管理有限公司，任公司总经理。现任公司总经理，兼任博时基金（国际）有限公司董事会副主席兼总裁（CEO）、博时资本管理有限公司副董事长兼总经理。

孔德伟先生，硕士，董事。2001年起，历任瑞银集团（香港分行，日本有限公司）亚太区IT主管、首席营运官、首席财务官，法国巴黎银行（香港）总裁办公室董事总经理，瑞银集团（香港）瑞银企业管理（上海）董事总经理。2012年11月加入招商证券股份有限公司，现任招商证券股份有限公司总裁助理，协助公司总裁管理固定收益总部、证券投资部及国际业务部（招证国际）。

王金宝先生，硕士，董事。1988年起在上海同济大学数学系工作，任教师。1995年4月进入招商证券股份有限公司，历任上海澳门路营业部总经理、上海地区总部副总经理（主持工作）、证券投资部总经理、投资部总经理兼固定收益部总经理、股票销售交易部总经理。现任招商证券股份有限公司机构业务董事总经理。2008年7月起，任博时基金管理有限公司董事会董事。

杨林峰先生，硕士，董事。1988年8月就职于国家纺织工业部，1992年起历任华源集团控股之上市公司董秘、副总经理、常务副总经理，上海市国资委直属上海大盛资产管理有限公司战略投资部副总经理。现任上海盛业资产管理有限公司执行董事、总经理。2013年8月起，任博时基金管理有限公司董事会董事。

何迪先生，硕士，独立董事。1971年起，先后在北京西城区半导体器件厂、北京东城区电子仪器一厂、中共北京市委党校、社科院美国研究所、加州大学伯克利分校、布鲁津斯学会、标准国际投资管理公司工作。1997年9月至今任瑞士银行投资银行部副主席。2008年1月，何迪先生建立了资助、支持中国经济、社会与国际关系领域中长期问题研究的非营利公益组织“博源基金会”，并担任该基金会总干事。2012年7月起，任博时基金管理有

限公司董事会独立董事。

李南峰先生，学士，独立董事。1969年起先后在中国人民解放军酒泉卫星基地、四川大学经济系、中国人民银行、深圳国际信托投资公司、华润深国投信托有限公司工作，历任中国人民银行总行金融研究所研究院、深圳特区人行办公室主任，深圳国际信托投资公司副总经理、总经理、董事长、党委书记，华润深国投信托有限公司总经理、副董事长。1994年至2008年曾兼任国信证券股份有限公司董事、董事长。2010年退休。2013年8月起，任博时基金管理有限公司董事会独立董事。

骆小元女士，学士，注册会计师（非执业）、高级经济师，独立董事，兼任中信银行外部监事。1982年起，先后在北京市委进出口委员会外经处、政财部财政科学研究所、中国注册会计师协会工作，历任中国财政学会会刊《财政研究》杂志副主编、编辑部主任，中国会计学会会刊《会计研究》、中国注册会计师协会会刊《中国注册会计师》编辑部主任、考试办公室主任兼全国注册会计师考试委员会委员、财务部主任、注册中心主任、总会计师等。2009年3月退休。

2、基金管理人监事会成员

车晓昕女士，硕士，监事。1983年起历任郑州航空工业管理学院助教、讲师、珠海证券有限公司经理、招商证券股份有限公司投资银行总部总经理。现任招商证券股份有限公司财务管理董事总经理。2008年7月起，任博时基金管理有限公司监事会监事。

彭毛宇先生，学士，监事。1982年8月起历任中国农业银行总行农贷部国营农业信贷处科员、副处长，中国农业发展银行开发信贷部扶贫信贷处处长，中国农业银行信贷管理三部扶贫贷款管理处处长，中国农业银行总行项目评估部副总经理、金桥金融咨询公司副总经理。1999年12月至2011年1月在中国长城资产管理公司工作，先后任评估咨询部副总经理，债权管理部（法律事务部）副总经理，南宁办事处副总经理（党委委员），监察审计部（纪委办公室）总经理。2007年12月至今兼任新疆长城金融租赁有限公司监事会主席。2011年1月至今任中国长城资产管理公司控股子公司专职监事（总经理级）。2011年7月起，任博时基金管理有限公司监事会监事。

赵兴利先生，硕士，监事。1987年至1995年就职于天津港务局计财处。1995年至2012年5月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012年5月筹备天津港（集团）有限公司金融事业部，2011年11月至今任天津港（集团）有限公司金融事业部副部长。2013年3月起，任博时基金管理有限公司监事会监事。

郑波先生，博士，监事。2001年起先后在中国平安保险公司总公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司人力资源部总经理。2008年7月起，任博时基金管理有限公司监事会监事。

林琦先生，硕士，监事。1998年起历任南天信息系统集成公司任软件工程师、北京万

豪力霸电子科技有限公司任技术经理、博时基金管理有限公司 MIS 系统分析员、东方基金管理有限公司总经理助理、博时基金管理有限公司信息技术部副总经理。现任博时基金管理有限公司信息技术部总经理。2010年4月起，任博时基金管理有限公司监事会监事。

赵卫平先生，硕士，监事。1996年起先后在山东国际信托投资公司、大鹏证券公司、北京证券公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司交易部总经理。2013年8月起，任博时基金管理有限公司监事会监事。

3、高级管理人员

杨鸷女士，简历同上。

吴姚东先生，简历同上。

王德英先生，硕士，副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发部经理、清华紫光股份公司 CAD 与信息事业部任总工程师。2000年加入博时基金管理有限公司，历任行政管理部副经理，电脑部副经理、信息技术部总经理。现任公司副总经理，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

董良泓先生，CFA，MBA，副总经理。1993年起先后在中国技术进出口总公司、中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、长城基金管理有限公司从事投资管理工作。2005年2月加入博时基金管理有限公司，历任社保股票基金经理，特定资产高级投资经理，研究部总经理兼特定资产高级投资经理、社保股票基金经理、特定资产管理部总经理。现任公司副总经理兼高级投资经理、社保组合投资经理，兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

邵凯先生，经济学硕士，副总经理。1997年至1999年在河北省经济开发投资公司从事投资管理工作。2000年8月加入博时基金管理有限公司，历任债券组合经理助理、债券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监。现任公司副总经理兼社保组合投资经理、兼任博时基金（国际）有限公司董事、博时资本管理有限公司董事。

孙麒清女士，商法学硕士，督察长。曾供职于广东深港律师事务所。2002年加入博时基金管理有限公司，历任监察法律部法律顾问、监察法律部总经理。现任公司督察长。

4、本基金基金经理

方维玲女士，硕士。1982年起曾先后在云南大学、海南省信托投资公司、湘财证券、北京玖方量子公司工作。2001年3月加入博时基金管理有限公司，历任金融工程小组金融工程师、数量化投资部金融工程师兼行政助理、数量化投资部副总经理兼金融工程师、产品规划部总经理、股票投资部投资经理、基金经理助理。现任上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金（2012.11.13-至今）、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2012.11.13-至今）、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金（2013.9.13-至今）、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2013.9.13-至今）的基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员：吴姚东、董良泓、邵凯、邓晓峰、黄健斌、魏凤春、聂挺进。

吴姚东先生，简历同上。

董良泓先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

邓晓峰先生，工商管理硕士。1996年起先后在深圳市银业工贸有限公司、国泰君安证券工作。2005年加入博时基金管理有限公司，历任基金经理助理、特定资产管理部副总经理、股票投资部价值组投资副总监。现任权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理、股票投资部价值组投资总监、博时主题行业股票(LOF)基金基金经理、社保组合投资经理。

黄健斌先生，工商管理硕士。1995年起先后在广发证券有限公司、广发基金管理有限责任公司投资管理部、中银国际基金管理有限公司基金管理部工作。2005年加入博时基金管理公司，历任固定收益部基金经理、博时平衡配置混合型基金基金经理、固定收益部副总经理、社保组合投资经理、固定收益部总经理。现任固定收益总部董事总经理兼高级投资经理、社保组合投资经理。

魏凤春先生，经济学博士。1993年起先后在山东经济学院、江南证券、清华大学、江南证券、中信建投证券公司工作。2011年正式加入博时基金管理有限公司。现任宏观策略部总经理兼投资经理。

聂挺进先生，硕士。2004年起在招商局国际有限公司工作。2006年加入博时基金管理有限公司，历任研究部研究员、研究部研究员兼基金经理助理、研究部资本品组主管兼基金经理助理、特定资产管理部投资经理、裕泽证券投资基金基金经理。现任研究部总经理兼股票投资部 GARP 组投资总监、博时卓越品牌股票基金、博时价值增长混合基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

1、依法申请并募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

6、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

7、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何

第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

- 8、进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- 9、依法接受基金托管人的监督；
- 10、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 11、采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- 12、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 14、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- 15、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 16、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 17、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- 18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- 19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- 22、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产；
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- (5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律

法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度

1、风险管理的原则

（1）全面性原则

公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节。

（2）独立性原则

公司设立独立的监察部，监察法律部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查。

（3）相互制约原则

公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则

建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

2、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察法律部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会

负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。

（2）风险管理委员会

作为董事会下的专业委员会之一，风险管理委员会负责批准公司风险管理系统文件，即负责确保每一个部门都有合适的系统来识别、评定和监控该部门的风险，负责批准每一个部门的风险级别。负责解决重大的突发的风险。

（3）督察长

独立行使督察权利；直接对董事会负责；按季向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议。

（4）监察法律部

监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标。

（5）风险管理部

风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

（6）业务部门

风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

3、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立内控结构，完善内控制度

公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察活动是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新。

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制

建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

（3）建立、健全岗位责任制

建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序

建立了评估风险的委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策。

（5）建立有效的内部监控系统

建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控。

（6）使用数量化的风险管理手段

采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失。

（7）提供足够的培训

制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，

控制风险。

第四部分 基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：010-66594942

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2014年6月30日，中国银行已托管276只证券投资基金，其中境内基金251只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，包括风险识别，风险评估，工作程序设计与制度建设，风险检视，工作程序与制度的执行，工作程序与制度执行情况的内部监督、稽核以及风险控制工作的后评价。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。

先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2013年，中国银行同时获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

第五部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、网下现金发售直销机构

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

电话：010-65187055

传真：010-65187032

联系人：尚继源

全国统一客服热线：95105568（免长途费）

2、网下现金发售代理机构

详见基金份额发售公告。

3、黄金现券发售代理机构

详见基金份额发售公告。

4、网上现金发售代理机构

详见基金份额发售公告。

5、基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减发售本基金的代理机构，并及时公告。

二、登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：0755-25946013

传真：0755-25987122

联系人：严峰

三、上海黄金交易所

名称：上海黄金交易所

注册地址：上海市黄浦区河南中路 99 号上海黄金交易所大厦

办公地址：上海市黄浦区河南中路 99 号上海黄金交易所大厦

电话：021-33189588

传真：021-33662058

联系人：杨艳

四、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

电话： 021- 31358666

传真： 021- 31358600

联系人：安冬

经办律师：吕红、安冬

五、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法人代表： 杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

第六部分 基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于2013年7月31日经中国证监会证监许可[2013]1026号文核准募集。

一、基金名称

博时黄金交易型开放式证券投资基金

二、基金的运作方式

交易型、开放式

三、基金存续期限

不定期

四、募集方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资者公开发售，销售机构的具体名单见基金份额发售公告。

本基金的募集方式包括现金认购和黄金现券认购。现金认购包括网上现金认购和网下现金认购。

网上现金认购是指通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购。

网下现金认购是指投资者通过基金管理人以现金进行的认购。

黄金现券认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以黄金现货合约进行的认购。

五、募集期限

本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。具体募集时间详见本基金份额发售公告。

如果在募集期间未达到本招募说明书第七部分第（一）款规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

六、募集对象

本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者（有关法律法规规定禁止购买者除外）、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

七、募集场所

投资者应当在基金管理人及其指定的发售代理机构办理基金发售业务的营业场所或按基金管理人、发售代理机构提供的其他方式办理基金的认购。基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的地区、网点的具体情况和联系方法，请参见本基金发售公告以及当地发售代理机构的公告。

基金管理人可以根据情况增减或变更发售代理机构，并另行公告。

八、基金份额面值、认购价格

本基金每份基金份额的初始面值为人民币1.00元，认购价格为人民币1.00元。

九、认购开户

投资者网上、网下现金认购本基金时需具有深圳证券交易所A股账户或证券投资基金账户。

投资者黄金现券认购本基金需同时具有深圳证券交易所A股账户或证券投资基金账户及上海黄金交易所黄金账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资者所有。

十、认购费用

本基金不收取认购费用。

投资人采用黄金现货实盘合约认购方式参与本基金认购所涉及的过户费等相关费用，按上海黄金交易所的相关规定自行承担。

十一、网上现金认购

1、认购时间详见本基金份额发售公告。

2、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为 1000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资者可多次认购，累计认购份额不设上限。

3、认购手续：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。

4、认购金额和利息折算的份额的计算：

本基金认购金额的计算如下：

认购金额=认购价格×认购份额

现金认购款项在基金募集期产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

利息折算的份额=利息/认购价格

其中，认购价格为基金份额的初始面值。

净认购份额=认购份额+利息折算的份额。

5、清算交收：T 日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构于 T+1 日与登记结算机构进行清算交收，登记结算机构于网上现金认购结束后的第 4 个工作日将实际到位的认购资金划往托管人的结算备付金账户。

6、认购确认：在募集期结束后 4 个工作日之后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十二、网下现金认购

1、认购时间详见本基金份额发售公告。

2、认购金额和利息折算的份额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请。

认购金额及利息折算的份额的计算公式为：

认购金额 = 认购份额 × 基金份额面值
净认购份额 = 认购份额 + 认购金额产生的利息 / 基金份额面值

3、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 10 万份以上（含 10 万份），超过部分须为 1 万份的整数倍，投资者可多次认购，累计认购份额不设上限。

4、认购手续：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

5、清算交收：通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人负责清算交收。现金认购款项在发行期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。

6、认购确认：在募集期结束后 4 个工作日之后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

十三、黄金现券认购

1、认购时间详见本基金份额发售公告。

2、认购限额：黄金现券认购以黄金现货实盘合约申报，用于认购的黄金现货合约包括 AU99.99、AU99.95 或者二者的组合。其中每种合约对应的黄金重量最低须为 1000 克，超过 1000 克的部分须为 1000 克的整数倍。投资者可多次提交认购申请，累计申报数量不设

上限。基金管理人可以根据情况变更或增加认购期间接受的黄金现货实盘合约品种，并另行公告。

3、认购手续：投资者在认购本基金时，需按发售机构的规定，到相应网点办理认购手续，并备足认购黄金现货合约。黄金现券认购申请提交后不得撤销。

4、清算交收

本基金黄金现券认购的销售机构为基金管理人及基金管理人指定的发售代理机构。

认购期内，基金管理人及基金管理人指定的发售代理机构将当日的现券认购数据报送给上海黄金交易所，黄金交易所进行账户校验后，根据校验结果当日将投资者账户内相应的黄金现货合约进行过户，并将处理结果发送给基金管理人。基金管理人为投资者计算认购份额，登记结算机构根据基金管理人提供的投资者认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

5、黄金现券认购份额的计算公式

$$\text{认购份额} = \frac{\sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只黄金现券在黄金现券认购期最后一日的结算价} \times \text{有效认购重量})}{\text{基金份额初始面值}}$$

其中：

- (1) i 代表投资者提交认购申请的第 i 只黄金现券， $n \leq 2$ 。
- (2) “第 i 只黄金现券在黄金现券认购期最后一日的结算价”指上海黄金交易所当日公布的结算价数据。
- (3) “有效认购重量”是指由基金管理人确认的并由登记结算机构及上海黄金交易所完成清算交收的黄金现券重量。

十四、募集资金利息处理方式

募集期间现金认购的利息折成份额后归投资者所有，具体份额以基金管理人和登记结算机构的记录为准。

十五、募集期间的资金、黄金现货合约与费用

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用；

募集的黄金现货实盘合约由黄金交易所在募集期内逐日过户至本基金预先开立的专门账户。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

第七部分 基金的备案

一、基金备案的条件

本基金募集期限届满，具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

1、基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含现券认购所募集的黄金现货实盘合约的市值）不少于 2 亿元人民币；

2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。

基金募集期内，本基金具备上述条件的，基金管理人可以决定停止基金发售，并按照规定办理验资和基金备案手续。

二、基金的备案

基金管理人应当自募集期限届满之日或停止基金发售之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

三、基金合同的生效

1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效；

2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。

四、基金募集失败的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金备案条件的，或因不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。基金管理人应当：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的认购款项或者黄金现货实盘合约。退还投资者已缴纳的认购款项时加计银行同期活期存款利息。

五、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

本合同存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

第八部分、基金份额折算与变更登记

基金份额折算是指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值的行为。基金份额折算由基金管理人向登记结算机构申请办理，并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。

本基金在上市前将进行基金份额折算。基金份额折算后的基金份额净值与折算基准日业绩比较基准（上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价）的 1/100 基本一致。

本基金存续期间，基金管理人可根据实际需要对基金份额进行折算，并提前公告。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响，无需召开基金份额持有人大会。

基金份额折算的具体方法在基金份额折算公告中列示。

第九部分 基金份额的交易

一、基金上市

基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请基金份额上市：

- 1、基金募集金额（含现券认购所募集的黄金现货实盘合约市值）不低于 2 亿元；
- 2、基金份额持有人不少于 1000 人；
- 3、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应在基金上市日前至少 3 个工作日发布基金上市交易公告书。

二、基金份额的上市交易

本基金的基金份额在深圳证券交易所的上市交易须遵照《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》，以及《深圳证券交易所交易规则》等有关规定。

三、暂停上市交易

基金份额上市交易期间出现下列情形之一的，深圳证券交易所可暂停基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、不再具备本章第一款规定的上市条件；
- 2、违反法律、行政法规，中国证监会决定暂停其上市；
- 3、严重违反深圳证券交易所有关规则的；
- 4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。

四、终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，深圳证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

- 1、暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- 2、基金合同终止；
- 3、基金份额持有人大会决定终止上市；
- 4、深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

基金管理人应当在收到深圳证券交易所终止基金上市的决定之日起 2 个工作日内发布基金终止上市公告。

若因上述 1、4 项等原因使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的，本基金将与联接基金合并，由交易型开放式基金变更为非上市的开放式基金。

五、基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人在每一个交易日开市前向深圳证券交易所提供当日基金的申购赎回清单。本基金基金份额参考净值（IOPV）由基金管理人或基金管理人委托的第三方计算，并交由深圳证券交易所发布，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

（1）基金份额参考净值的计算公式：

基金份额参考净值 = (Au99.99 现货实盘合约最新成交价 + 每千克 Au99.99 现货实盘合约对应的预估现金差额/1000) / 100。

（2）基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 4 位。

（3）基金管理人可以调整基金份额参考净值的计算公式，并予以公告。

第十部分 基金份额的申购与赎回

本基金的申购与赎回模式分为场内申赎模式和场外申赎模式。场内申赎模式下，投资者可以通过上海黄金交易所会员或深圳证券交易所会员分别采用现券或现金申购赎回本基金。场外申赎模式下，投资人可以通过基金管理人直销等场外机构采用现券或现金申购赎回本基金。

基金管理人将在开始申购、赎回业务前公告所采用的申赎模式，并对有关规则和程序予以公告。

一、申购与赎回的模式

在场外申赎模式和场内申赎模式下，本基金均可进行现券申赎和现金申赎。本基金的主要申赎方式为现券申赎。

二、申购与赎回的场所

（一）、场内申赎模式

1、现券申赎

场内申赎模式下，本基金现券申赎的申赎代理机构主要为具有基金代销资格的上海黄金交易所会员。

投资者应当在申赎代理机构的营业场所按申赎代理机构提供的方式办理基金的申购和赎回。

本基金管理人将在开始申购、赎回业务前公告申赎代理机构的名单，并可依据实际情况增加或减少申赎代理机构。

2、现金申赎

场内申赎模式下，本基金现金申赎可通过具有基金代销资格的深交所会员等场内机构进行。

（二）、场外申赎模式

场外申赎模式下，本基金的现券申赎、现金申赎均通过基金管理人直销等场外机构进行。投资者应当按照基金管理人直销等场外机构要求的方式办理基金的申购和赎回。

本基金管理人可依据实际情况增加或减少场外申赎代理机构。

三、申购与赎回办理的开放日及时间

1、申购、赎回的开始时间

本基金的申购自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

本基金的赎回自基金合同生效日起不超过 3 个月的时间开始办理。

在确定申购开始时间与赎回开始时间后，由基金管理人最迟于申购或赎回开始前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

2、开放日及开放时间

通常情况下，投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所和上海黄金交易所的共同交易日，开放时间为上午 9:30-11:30 和下午 13:30-15:00，具体以基金份额开放申购赎回业务公告为准。场外申赎模式下，基金管理人可根据情况变化对上述时间作出调整。

本基金场内申赎模式和场外申赎模式下开放时间可能存在差异，投资者应关注基金管理人发布的有关公告并注意提交交易申请的时间。

场外申赎模式下，投资者在开放时间以外提交的申购、赎回等交易申请，登记结算机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

若深圳证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况，基金管理人可对开放日、开放时间进行相应的调整并公告。

四、申购与赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购、赎回均以份额申请；
- 2、本基金的申购对价、赎回对价包括黄金现货实盘合约、现金替代、现金差额及其他对价；
- 3、本基金的申购、赎回方式分为现券申赎和现金申赎；
- 4、申购、赎回申请提交后不得撤销；
- 5、申购赎回应遵守《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、上海黄金交易所相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定；
- 6、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

五、申购与赎回的程序

（一）、账户备案

在现券申赎的场内申赎模式下，投资者提交黄金现券申购、赎回申请前必须先进行账户备案。

1、场内申赎模式

现券申赎的场内申赎模式下，投资者提交黄金现券申购、赎回申请前须通过上海黄金交易所会员向上海黄金交易所申请账户备案。投资者 T 日提交账户备案申请并通过验证后，可于 T+2 日进行基金申赎。

2、场外申赎模式

现券申赎的场外申赎模式下，投资者提交黄金现券申购、赎回申请前须按基金管理人等场外机构的要求，提供账户信息并确保信息的准确、完整。基金管理人依照金交所、深交所的黄金过户、份额登记确认数据完成投资人账户信息的收集、建立、备案，并在投资者后续的交易过程中进行账户检查。

（二）、申购与赎回申请的提出

基金投资者须按基金管理人或申赎代理机构规定的手续及申购、赎回清单，在开放日的开放时间提出申购或赎回的申请。

采用现券申赎方式的投资者，应通过黄金交易所会员开立并持有黄金交易所账户。投资者提交申购申请时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的黄金现货实盘合约和现金。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金，否则申请无效。

采用现金申赎方式的投资者，提交申购申请时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的现金。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和预估现金，否则申请无效。

（三）、申购与赎回申请的确认

基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

（四）、申购和赎回的清算交收与登记

1、场内申赎模式

（1）现券申购

场内申赎模式下，投资者 T 日提交申购申请，上海黄金交易所进行必要的身份验证后冻结黄金合约，并通知深圳证券交易所记增投资者份额。金交所收到深交所反馈后，对份额增加成功的申购申请进行黄金合约过户，对于份额增加失败的申请进行黄金合约的解冻。T 日日终，登记结算机构完成份额登记。

（2）现券赎回

场内申赎模式下，投资者 T 日提交赎回申请，上海黄金交易所检查投资者的身份验证情况后将数据发送给深圳证券交易所。深圳证券交易所冻结投资者基金份额。上海黄金交易所收到深圳证券交易所的基金份额冻结结果后将黄金合约从黄金 ETF 账户过户到投资者账户，投资人黄金合约当日可用。T 日日终，登记结算机构完成份额登记。

（3）现金申购

场内申赎模式下，投资者 T 日通过基金管理人指定的申赎代理机构向登记结算机构提交申购申请。T 日日终，登记结算机构对现金替代款进行交收，并记增投资者 ETF 份额。

（4）现金赎回

场内申赎模式下，投资者 T 日通过基金管理人指定的申赎代理机构向登记结算机构提交赎回申请。T 日日终，登记结算机构记减投资者份额。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的 3 个工作日前在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、黄金现券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限公司深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》、上海黄金交易所相关业务规

则和参与各方相关协议的有关规定。本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付方式，申购现金替代款采用 T+0 逐笔全额非担保交收。

登记结算机构和基金管理人可在法律、法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，可以对申购和赎回的程序进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体公告。

2、场外申赎模式

(1) 现券申购

场外申赎模式下，投资者 T 日提交申购申请，由基金管理人向上海黄金交易所发送申购数据，上海黄金交易所当日进行必要的身份验证后完成黄金过户，并将黄金过户结果发送至基金管理人。T+1 日登记结算机构根据基金管理人提供的基金份额确认数据进行份额登记。T+2 日，投资者份额可用。

(2) 现券赎回

场外申赎模式下，投资者 T 日提交赎回申请，由基金管理人向登记结算机构发送赎回数据，T 日日终，登记结算机构根据基金管理人申请记减投资者基金份额。T+1 日，基金管理人将 T 日成功记减份额的赎回申请生成确认文件发送给金交所。T+1 日金交所完成黄金过户。投资者黄金现货合约 T+2 日可用。

(3) 现金申购

场外申赎模式下，投资者 T 日通过基金管理人向登记结算机构提交申购申请。T 日日终，登记结算机构记增投资者 ETF 份额，投资者份额 T+1 可用。

(4) 现金赎回

场外申赎模式下，投资者 T 日通过基金管理人向登记结算机构提交赎回申请。T 日日终，登记结算机构记减投资者 ETF 份额。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的 3 个工作日前在中国证监会指定的信息披露媒体公告。

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、黄金现券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限公司深圳分公司交易型开放式基金登记结算业务指南》、上海黄金交易所相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定，本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款由基金管理人与投资者完成交收，投资者在提交申请时应将现金替代款、预估现金及时划入基金管理人指定的银行账户。

登记结算机构和基金管理人可在法律、规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，可以对申购和赎回的程序进行调整，并最迟于开始实施前 3 个工作日在指定媒体公告。

六、申购与赎回的数额限制

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

本基金现券申购、赎回方式下，最小申购、赎回单位由基金管理人确定和调整。目前，本基金的最小申购、赎回单位为 30 万份，投资人提出申购申请前需按 3000 克或其整数倍备足用于申购的 Au99.95 或 Au99.99 现货实盘合约，或 Au99.95 和 Au99.99 两种现货实盘合约的组合，基金管理人可根据市场情况，对最小申购、赎回单位进行调整，基金管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

基金管理人可设定申购上限和赎回上限，以对当日的申购总规模或赎回总规模进行控制，并在申购赎回清单中公告。

基金管理人可设定单个投资人累计持有的基金份额上限。

七、申购与赎回的对价和费用

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

申购、赎回清单由基金管理人编制。

3、投资者在申购或赎回基金份额时，申赎代理机构可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，具体规定请参见申赎代理机构、证券交易所、登记结算机构相关规定。

4、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。

八、申购赎回清单的内容与格式

（一）现券申购赎回清单的内容

1、申购赎回清单的内容

T 日申购赎回清单公告内容包括一级市场基金代码、最小申购赎回单位、T-1 日各黄金现货实盘合约对应的现金差额（元/千克）、T 日各黄金现货实盘合约对应的预估现金差额（元/千克）、T-1 日基金份额净值、申购上限、赎回上限、申购赎回标志等。

2、预估现金相关内容

预估现金是指为便于申赎代理机构预先冻结申请申购、赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T 日申购赎回清单中公告 T 日预估现金。其计算公式为：

T 日每千克 Au99.99 现货实盘合约预估现金差额 = (T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - T-1 日最小申购、赎回单位对应的黄金现货重量 × Au99.99 现货实盘合约 T-1 日收盘价 × 1000 克) ÷ T-1 日最小申购、赎回单位对应的黄金现货重量

T 日每千克 Au99.95 现货实盘合约预估现金差额 = (T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - T-1 日最小申购、赎回单位对应的黄金现货重量 × Au99.95 现货实盘合约 T

-1 日收盘价 $\times 1000$ 克) $\div T-1$ 日最小申购、赎回单位对应的黄金现货重量

预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。预估现金差额计算至小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。若 T 日为基金分红除息日，上述计算公式中“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额

3、现金差额相关内容

T 日现金差额在 (T+1) 日的申购、赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日每千克 Au99.99 现货实盘合约现金差额 = (T 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - T 日最小申购、赎回单位对应的黄金现货重量 \times Au99.99 现货实盘合约 T 日收盘价 \times 1000 克) \div T 日最小申购、赎回单位对应的黄金现货重量

T 日每千克 Au99.95 现货实盘合约现金差额 = (T 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - T 日最小申购、赎回单位对应的黄金现货重量 \times Au99.95 现货实盘合约 T 日收盘价 \times 1000 克) \div T 日最小申购、赎回单位对应的黄金现货重量

现金差额的数值可能为正、为负或零。现金差额计算至小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

① 在投资人申购时，若现金差额为正数，则投资人应根据其申购的基金份额对应的黄金现货实盘合约类型和黄金现货重量支付相应的现金；若现金差额为负数，则投资人将根据其申购的基金份额对应的黄金现货实盘合约类型和黄金现货重量获得相应的现金。

② 在投资人赎回时，若现金差额为正数，则投资人将根据其赎回的基金份额及基金管理人支付的黄金现货实盘合约类型和黄金现货重量获得相应的现金；若现金差额为负数，则投资人应根据其赎回的基金份额及基金管理人支付的黄金现货实盘合约类型和黄金现货重量支付相应的现金。

4、申购赎回清单的格式

T 日现券申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期	
基金名称	
基金管理公司名称	
一级市场基金代码	
申购赎回方式	
T-1 日信息内容	
AU99.99 现金差额 (单位: 人民币元/千克)	
AU99.95 现金差额 (单位: 人民币元/千克)	
最小申购赎回单位基金净值 (单位: 人民币元)	
基金份额净值 (单位: 人民币元)	
T 日信息内容	
Au99.99 预估现金 (单位: 人民币元/千克)	
Au99.95 预估现金 (单位: 人民币元/千克)	
当天累计可申购的基金份额上限 (单位: 份或千克)	

当天累计可赎回的基金份额上限（单位：份或千克）	
是否需要公布 IOPV	
最小申购赎回单位（单位：份）	
最小申购赎回单位分红金额（单位：人民币元）	
是否允许申购	
是否允许赎回	
是否接受 Au99.99 现货实盘合约申购	
是否接受 Au99.95 现货实盘合约申购	
黄金现货合约信息内容	
黄金现货合约	合约数量（克）
Au99.99 合约和/或 Au99.95 合约	3000

备注：此表为示例

5、在现券申购、赎回方式下，通过深圳证券交易所及其他渠道公布的本基金现券申购赎回清单内容取决于其接受的申购赎回清单格式，与基金管理人网站公布的申购赎回清单在内容或格式上可能略有差异。申购赎回清单的具体内容以基金管理人届时在网站上公布的实际内容为准

（二）现金申购赎回清单的内容

1、申购赎回清单的内容

T 日申购赎回清单内容包括：一级市场基金代码、最小申购、赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各黄金合约数据、现金替代、现金差额、预估现金差额、T-1 日基金份额净值、当日申购上限、当日赎回上限及其他内容。

2、申赎现金

“申赎现金”不属于组合证券，是为了便于登记结算机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的成份证券的可以现金替代金额之和，赎回替代金额固定为 0。

3、组合证券

组合证券是指本基金投资组合所包含的全部或部分黄金现货实盘合约。申购赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各黄金现货实盘合约的合约名称、合约代码及数量。在场内份额现金申购、赎回方式下，组合证券仅包括 Au99.99 现货实盘合约。

基金管理人可根据投资组合的实际情况及未来具体业务的需要，调整组合证券的内容及其构成，并根据组合证券的内容相应调整现金替代相关内容。

4、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回本基金场内份额的过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代黄金现货实盘合约的一定数量的现金。

① 现金替代仅包括可以现金替代（标志为“允许”）。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部黄金现货实盘合约的替

代，在赎回基金份额时，该黄金现货实盘合约只允许使用现金作为替代。

② 替代金额的计算公式为：

替代金额 = 允许现金替代的黄金现货实盘合约数量 × 该黄金现货实盘合约前一交易日收盘价 × (1 + 现金替代溢价比例)。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的黄金现货实盘合约，基金管理人代替申购投资人买入黄金现货实盘合约的实际交易价格加上相关交易费用后与申购时的价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分黄金现货实盘合约的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分黄金现货实盘合约的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。

③ 替代金额的处理程序

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

登记结算机构为投资人办理申购基金份额与现金替代交收后的次日，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的黄金现货实盘合约。基金管理人以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若当日未能购入全部被替代的黄金现货实盘合约，则以替代金额与所购入的部分被替代黄金现货实盘合约实际购入成本加上按照当日收盘价计算的未购入的部分被替代黄金现货实盘合约价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

登记结算机构为投资人办理赎回基金份额交收后的次日，基金管理人将卖出被替代的黄金现货实盘合约。基金管理人根据卖出的被替代证券的实际卖出金额（扣除相关费用），确定应支付投资人的赎回现金替代款；若当日未能卖出全部被替代的黄金现货实盘合约，则以卖出的被替代证券的实际卖出金额（扣除相关费用）加上当日收盘价计算的未卖出的部分被替代黄金现货实盘合约价值，确定支付投资人的赎回现金替代款。

5、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人估计并在 T 日现金申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理机构预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

T 日预估现金差额 = T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值 - 申购赎回清单中可以现金替代的黄金现货实盘合约所代表的黄金现货重量与 T-1 日收盘价乘积之和。

其中，黄金现货实盘合约所代表的黄金现货重量根据黄金现货实盘合约的数量与该合约交易单位的乘积进行计算。

预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。

6、现金差额相关内容

T 日现金差额在 T+1 日的申购赎回清单中公告。其计算公式为：

$T \text{ 日现金差额} = T \text{ 日最小申购、赎回单位的资产净值} - \text{申购赎回清单中可以现金替代的黄金现货实盘合约所代表的黄金现货重量} \times T \text{ 日收盘价}$ 乘积之和。

其中，黄金现货实盘合约所代表的黄金现货重量根据黄金现货实盘合约的数量与该合约交易单位的乘积进行计算。T 日投资人以现金申购、赎回方式申购、赎回本基金场内份额时，需按基金管理人 T+1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资人申购时，如现金差额为正数，则投资人应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资人赎回时，如现金差额为正数，则投资人将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

T 日现金申购赎回清单格式举例如下：

基本信息							
最新公告日期							
基金名称							
基金管理公司名称：							
基金代码：							
目标指数代码：							
申购赎回方式：							
T-1 日信息内容							
T-1 日现金差额（单位：人民币元）：							
最小申购、赎回单位资产净值（单位：人民币元）							
基金份额净值（单位：人民币元）							
T 日信息内容							
预估现金差额：							
最小申购、赎回单位（单位：份）							
最小申购、赎回单位分红金额（单位：人民币元）							
是否需要公布 IOPV：							
是否允许申购							
是否允许赎回							
是否允许现金申购							
可以现金替代比例上限：				100.00%			
当天累计可申购的基金份额上限：							
当天累计可赎回的基金份额上限：							
T 日组合信息内容							
证券代码	证券简称	股份数量	现金替代标志	现金替代保证金率	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场
159900	申赎现金		必须		940,500.00	0.00	深圳市场
Au9999	Au9999	3000	允许	10%			上海黄金交易所

备注：此表为示例。申赎替代金额中包括溢价现金部分，其所对应的黄金现货合约仅为

Au99.99。

7、在现金申购、赎回方式下，通过深圳证券交易所及其他渠道公布的本基金现金申购赎回清单内容取决于其接受的申购赎回清单格式，与基金管理人网站公布的申购赎回清单在内容或格式上可能略有差异。申购赎回清单的具体内容以基金管理人届时在网站上公布的实际内容为准。

九、暂停申购、赎回和延缓支付赎回款的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购、赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法受理投资者的申购申请；
- (2) 黄金交易所、证券交易所等交易场所交易时间非正常停市或临时停市；
- (3) 深圳证券交易所、上海黄金交易所、申赎代理机构、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者因异常情况使申购、赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；
- (4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (5) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；
- (6) 无法按时公布基金份额净值或者 IOPV 计算错误；
- (7) 当日申购或赎回申请达到基金管理人设定的申购上限或赎回上限的情况
- (8) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停，基金管理人可同时暂停场内现券、场内现金、场外现券、场外现金方式的申购、赎回或延缓支付赎回款项，也可只针对其中一种或部分方式暂停申购、赎回或延缓支付赎回款项。。

发生上述情形时，基金管理人应在当日向中国证监会备案，并及时公告。在暂停申购、赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依法公告。

发生上述第（2）、（3）、（4）、（6）等项情形时，对于已经确认的赎回申请，基金管理人可以根据该情形的实际影响延缓支付赎回款项。

十、集合申购与其他服务

在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的黄金现券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。

基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和本基金合同的规定开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况和新业务的需求对上述申购和赎回的安排、规则进行补充和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。补充和调整事项包括但不限于：

1、在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可根据实际情况，调整本基金场外份额的申购、赎回原则及申购、赎回方式，或停止办理本基金场外份额的申购、赎回业务。如基金管理人决定调整场外份额的申购、赎回方案，应于新的申购、赎回方案开始实施前予以公告。如决定停止办理场外份额的申购、赎回业务，基金管理人应采取适当措施对本基金基金份额持有人所持有的场外份额作出妥善安排并提前公告。

2、在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可为本基金增设新的份额类别或进行基金份额分级。基金管理人可就分级运作后的全部或部分份额申请场内交易，制定并公布相应的业务规则。

3、在条件允许时，基金管理人也可采取其他合理的申购方式，并于新的申购方式开始执行前予以公告。

4、未来，在相关条件成熟时，本基金可向已开立上海黄金交易所黄金账户的投资人开放现金申购、赎回。具体的申购、赎回办法届时见基金管理人的相关公告。

十一、联接基金的投资

本基金的联接基金可投资于本基金，与本基金实现同一投资目标。

十二、基金的非交易过户、冻结、解冻等其他业务

基金的登记结算机构可依据其业务规则，受理基金的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

第十一部分 基金的投资

一、投资目标

本基金通过投资于黄金交易所的黄金现货合约，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标的指数表现接近的投资回报。

二、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。本基金主要投资于黄金交易所的黄金现货合约，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。

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，黄金现货实盘合约中，本基金将主要投资于 AU99.99。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法买入足够的 AU99.99 时，基金管理人可投资于 AU99.95 和 AU（T+D）或其他品种以进行适当替代。

本基金将黄金现货延期交收合约 AU（T+D）作为投资 AU99.99 的替代补充的原因，首先是 AU（T+D）是黄金现货延期交收合约中流动性最好的品种，可以作为流动性不足最好的替代品种；其次，AU（T+D）交易费用较黄金现货实盘低；另外 AU（T+D）对跟踪误差影响小；最后，AU（T+D）可随时申请现券交割，且交割标准为 AU99.95，与备选投资标的一致。

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。

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，此调整无须召开持有人大会。本基金可从事黄金现货租赁业务。

三、标的指数

上海黄金交易所的黄金现货实盘合约 AU99.99 价格。

四、投资策略

本基金主要采取被动式管理策略。

本基金投资于黄金现货合约的资产比例不低于基金资产的 90%。

基于跟踪误差、流动性因素和交易便利程度的考虑，黄金现货实盘合约中，本基金将主要投资于 AU99.99。但因特殊情况（包括但不限于流动性不足等）导致本基金无法买入足够的 AU99.99 时，基金管理人可投资于 AU99.95 和 AU（T+D）或其他品种以进行适当替代。

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。

五、投资决策流程

1、投资决策依据

有关法律、法规、基金合同的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责做出有关投资管理重大事项的决策。基金经理负责做出组合日常维护过程中的组合构建、组合调整及基金每日申购赎回清单的编制等决策。

3、投资管理程序

本基金的投资管理程序如下：

（1）研究

基金管理人的投资及研究部门将依托公司整体研究平台，整合外部信息包括券商、独立第三方等外部研究力量的研究成果，开展对全球及国内黄金市场的跟踪研究及其流动性的监控，并定期撰写相关的研究报告，作为本基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策

基金管理人的投资决策委员会依据相关研究报告，定期或遇重大事件时临时召开投资决策委员会会议，对相关事项做出决策。基金经理根据投资决策委员会的决议，做出基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建

基金经理主要采取被动式管理策略，以不低于 90%的组合资产投资于上海黄金交易所黄金现货合约。日常组合构建中，基金经理将根据不同黄金现货合约的流动性，选择恰当的黄金现货合约品种构建基金投资组合。在追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化的前提下，基金经理可采取适当的方法，提高投资效率，降低交易成本，控制投资风险。

（4）交易执行

交易部负责本基金的具体交易执行，交易部同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估

本基金管理人定期和不定期对本基金的投资绩效进行评估，确认基金组合是否实现了投资预期，并对跟踪误差的来源进行归因分析等。基金经理依据绩效评估报告总结或检讨以往的投资策略及投资流程，如果需要，亦对投资组合流程进行相应的调整。

（6）组合监控与调整

基金经理根据本基金现金方式的净申购赎回、日常现券申购赎回交收的现金流量情况，以及基金投资绩效评估结果等，对基金投资组合中的黄金现货合约的持仓及现金头寸进行动态监控和调整，密切跟踪投资标的。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,根据环境的变化和基金实际投资的需要,有权对上述投资管理程序做出调整,并将调整内容在基金招募说明书及招募说明书更新中予以公告。

六、投资组合管理

1、投资组合的构建

基金管理人构建基金投资组合的过程主要分为三个步骤:确定目标组合、制定及实施建仓策略以及逐步调整组合。

(1) 确定目标组合

基金管理人主要采取被动式管理策略,买入标的指数所对应的黄金现货实盘合约构建基金投资组合。

(2) 制定及实施建仓策略

基金经理依据对主要黄金现货合约的流动性和交易成本等因素所做的分析,制定合理的建仓策略。

(3) 逐步调整组合

本基金投资于国内黄金现货合约的资产比例不低于基金资产的 90%。本基金将在基金合同生效之日起 3 个月内达到这一投资比例。此后,如因基金申购赎回等因素导致基金投资组合不符合这一投资比例的,基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。

2、投资组合的日常管理

本基金投资组合的日常管理内容主要包括以下几个方面:

(1) 跟踪误差的日常管理

基金经理及时对跟踪误差进行归因分解,了解跟踪误差来源,保持对投资标的的跟踪与分析,重点关注不同黄金现货实盘合约的流动性、投资组合流动性的变化、申购赎回及现金头寸对跟踪误差的影响,以便及时调整组合,降低影响,最小化跟踪误差。

(2) 投资组合的再平衡。

由于申购赎回、组合现金头寸、黄金现货延期交收合约与现货实盘合约表现存在差异等因素的影响,使组合偏离标的指数较大时,基金经理需要对组合中不同黄金现货合约的持仓进行平衡调整

(3) 基金每日申购赎回清单的制作

基金经理以 T-1 日投资标的的数量、价格及组合数据为基础,制作 T 日基金申购赎回清单并予以公告。

3、投资组合的定期管理

本基金投资组合的定期管理内容主要包括以下几个方面:

每周末,基金经理对投资组合表现及跟踪误差等进行分析,分析最近组合的跟踪偏离度和跟踪误差情况,寻找出未能有效控制偏离的原因,为进一步修正组合提供参考。

每月末，根据基金合同中关于基金管理费、基金托管费和基金仓储费等的支付要求，进行现金支付的准备。必要时，本基金将以卖出黄金现货实盘合约的方式支付基金所须负担的各项费用。。

每季末，基金经理检查组合各类资产的法规比例，需要时则调整组合，以达到符合信息披露要求的法规比例。

4、投资组合的交易

本基金的主要投资对象为上海黄金交易所的上市交易的黄金现货合约。

为了保持本基金的竞争力，尽量降低中间环节的费用，本基金拟向上海黄金交易所申请开立特别交易通道，满足本基金对实物黄金高效、低成本的投资需要。

七、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为黄金现货实盘合约 AU99.99 收益率。

基金管理人有权变更本基金的业绩比较基准，而无需召开基金份额持有人大会。

八、风险收益特征

本基金主要投资对象为黄金现货合约，预期风险/收益水平与黄金相似，在证券投资基金中属于较高风险和预期收益的基金品种。

九、投资禁止行为与限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (8) 依照法律、行政法规有关法律法规规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

- (1) 本基金投资于黄金现货合约的资产比例不低于基金资产的 90%；
- (2) 法律法规和基金合同规定的其他限制。

3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更，致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消，基金管理人在依法履行相应程序后，本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

十、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

十一、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券，从事黄金租赁。

第十二部分 基金的财产

一、基金资产总值

基金资产总值是指本基金拥有的黄金现货合约、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

二、基金资产净值

本基金的基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

三、基金财产的账户

本基金根据相关法律法规、规范性文件开立基金资金账户以及证券账户、黄金账户，与基金管理人和基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户独立。

四、基金财产的保管及处分

- 1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。
- 2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。
- 3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。
- 4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

第十三部分 基金资产的估值

一、估值目的

基金估值的目的是为了准确、真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。开放式基金份额申购、赎回价格应按基金估值后确定的基金份额净值计算。

二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

三、估值对象

本基金所拥有的黄金现货合约及其他各类有价证券。

四、估值方法

1、黄金现货实盘合约估值方法

黄金现货实盘合约按估值日其所在交易所的当日收盘价估值；估值日无交易的，以最近收盘价估值。

2、黄金现货延期交收合约估值方法

黄金现货延期交收合约按估值日其所在交易所的当日结算价估值；估值日无交易的，以最近结算价估值。

3、其他有价证券

其他有价证券按有关规定估值。

4、本基金持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

5、本基金持有的银行存款和备付金余额以本金列示，按相应利率逐日计提利息。

6、在任何情况下，基金管理人采用上述 1-5 项规定的方法对基金财产进行估值，均应当被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按上述方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按国家最新规定进行估值。

五、估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果报给基金托管人，基金托管人按《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

六、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；

3、中国证监会认定的其他情形。

七、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金份额净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

八、估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位（含第四位）内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

2、基金管理人和基金托管人将采取必要、适当合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并同时报中国证监会备案。

3、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

九、特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第（四）款有关估值方法规定的第 6 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于黄金交易所及登记结算公司发送的数据错误，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

第十四部分 基金的收益与分配

一、收益的构成

基金本期利润是指基金本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。基金本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

二、收益分配原则

本基金以使收益分配后基金累计收益率尽可能贴近标的指数同期累计收益率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。本基金的收益分配应遵循下列原则：

- 1、基金收益分配采用现金方式；
- 2、每一基金份额享有同等分配权；
- 3、基金收益评价日核定的基金累计收益率超过标的指数同期累计收益率达到 1%以上，方可进行收益分配；
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 2 次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 5%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；
- 5、期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；
- 6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配数额的确定原则

- 1、在收益评价日，基金管理人计算基金累计收益率、标的指数同期累计收益率。

基金收益评价日本基金相对标的指数的超额收益率 = 基金累计收益率 - 标的指数同期累计收益率。

基金累计收益率为当日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 100%；标的指数累计收益率为当日标的指数收盘价与基金上市前一日标的指数收盘价之比减去 100%。

期间如发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算、拆分或合并日为初始日重新计算上述指标。

- 2、根据前述收益分配原则计算截至基金收益评价日本基金的份额可分配收益，并确定收益分配比例。

四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配基准日以及该日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、支付方式及有关手续费等内容。

五、收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核后确定，基金管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并公告。

六、收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。

第十五部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的上市费及年费；
- 4、基金收益分配发生的费用；
- 5、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 6、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 9、基金资产的资金汇划费用；
- 10、黄金现货合约交易手续费、延期补偿费、交割费、过户费及仓储费；
- 11、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- 12、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.1% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第一款第3至第12项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

三、不列入基金费用的项目

本条第一款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

四、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

五、其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

六、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

第十六部分 基金的会计与审计

一、基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度按国家有关的会计核算制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关法律法规规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二、基金审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券业务资格的会计师事务所及其注册会计师等对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须报中国证监会备案。基金管理人应在更换会计师事务所后 2 日内公告。
- 3、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；

第十七部分 基金的信息披露

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过至少一种指定媒体和基金管理人的互联网网站等媒介披露,并保证投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

一、基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后,基金管理人应当在基金份额发售的 3 日前,将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

基金合同生效后,基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内,更新招募说明书并登载在网站上,将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人应当在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书,并就有关更新内容提供书面说明。

二、基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

三、基金合同生效公告

基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒体和网站上登载基金合同生效公告。

四、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的,基金管理人应当在基金份额上市交易前 3 个工作日将基金份额上市交易公告书登载在指定媒体上。

五、基金资产净值、基金份额净值公告

基金合同生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回之后,基金管理人应当在每个开放日的次日,通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介,披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

六、定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制,由基金托管人按照法律法规的规定对相关内容进行复核。基金定期报告,包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告及更新的招募说明书。

1、基金年度报告:基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内,编制完成基金年度报

告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

2、基金半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

七、临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件，包括：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、基金变更、增加、减少基金代销机构；
- 20、基金更换基金注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 24、基金份额上市交易；
- 25、基金份额持有人大会的决议
- 26、中国证监会规定的其他事项。

八、公开澄清

在基金合同期限内,任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。

九、信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金代销机构的住所,投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,投资者在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件复印件。

第十八部分 风险揭示

本基金管理人将针对本基金的特点，建立相应的风险管理体系，对本基金整个投资过程进行有效的风险监控。本基金的特定风险包括以下几个方面：

一、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。影响黄金价格的主要因素为：

1、黄金的供给和需求：

- (1) 黄金生产商利用远期合约、黄金现货合约进行对冲和头寸调整；
- (2) 中央银行买卖黄金改变其储备；
- (3) 主要黄金生产国家如南非、澳大利亚和美国等国家在开采成本方面绝对水平的变化；

化：

- 2、全球和地区性政治经济环境、金融体系稳定性的改变和突发事件的发生；
- 3、投资者对通货膨胀预期的变化；
- 4、外汇汇率和利率水平的变化；
- 5、对冲基金和商品共同基金的投资和交易行为的变化。

本基金力求紧密跟踪黄金现货合约价格变化，投资者需明确本基金的价值为黄金现货合约价值扣除仓储、管理和托管等费用之后的价值。扣除各种费用支出后，本基金单位份额所代表的黄金份额可能会不断下降。

二、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实盘合约。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。

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，以下原因可能造成本基金折溢价率高于股票类ETF：

- (1) 涨跌停板制度不同

深圳证券交易所上市的证券，有 10%的涨跌幅限制，而作为基金主要投资标的的黄金现货合约，涨跌幅限制为 30%。因此，如果黄金现货合约涨跌幅度超过 10%，由于基金份额二级市场涨跌幅受限，则基金份额二级市场价格相对基金份额净值可能出现较大折溢价，不能及时准确反映基金份额净值的变化情况。

(2) 上市交易时间不同

本基金的交易与申赎时间与深圳证券交易所开市时间一致，而深圳证券交易所和上海黄金交易所的交易时间不完全重合，由下表数据可见，每个交易日上海黄金交易所比深圳证券交易所的开市时间多了 6 小时。

图表：深圳证券交易所与上海黄金交易所连续交易时间

	上午	下午	晚上
深圳证券交易所	9:30-11:30	13:00-15:00	
上海黄金交易所	9:00-11:30	13:30-15:30	21:00-2:30

来源：博时基金、上海黄金交易所（如果上海黄金交易所或深圳证券交易所交易时间发生变更，以上海黄金交易所或深圳证券交易所的交易规则或通知公告为准）

交易时间不一致可能导致的风险有：当日 15:00 基金份额二级市场收盘价格与 15:30 后基金份额净值可能存在较大差异；若上海黄金交易所夜间市场涨跌幅度超过 10%，次日二级市场基金份额交易价格无法及时反映基金份额净值的变化，从而导致折溢价率较大。

(3) 公众假期不同

深圳证券交易所和上海黄金交易所的公众假期可能不同，可能存在上海黄金交易所正常交易而深圳证券交易所暂停交易的情况。

若投资标的在深圳证券交易所休市期间累计涨跌幅较大，当假期结束后本基金份额开始交易时，可能因涨跌幅度限制导致基金份额的交易价格无法及时反映基金份额净值，存在较大折溢价。

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实盘合约，则现券认购申请失败。

(2) 如投资人通过场内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实盘合约，或未根据申购赎回清单的要求备足预估现金差额，则场内现券申购申请失败；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

黄金现货实盘合约，或未能按照基金管理人的要求备足预估现金差额，则场外现券申购申请失败。

(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场内现券申赎、场内现金申赎、场外现券申赎、场外现金申赎，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。

(1) 就目前的方案而言,仅有无法开立上海黄金交易所黄金账户的投资人方可以场内或场外现金方式申购、赎回本基金份额。可以开立上海黄金交易所黄金账户的投资人必须先开立黄金账户,在通过本基金销售机构办理相关的账户备案手续后,方可参与本基金的现券申购、赎回。

(2) 投资人参与本基金的现金申购、赎回不需要进行账户备案,而投资人首次参与本基金的现券申购、赎回前,需通过销售机构进行账户备案。

(3) 由于本基金场内现券申赎、场外现券申赎、场内现金申赎、场外现金申赎遵循不同的申购、赎回原则,交易和结算规则均有较多差异。

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。

三、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。

现券赎空风险: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。

四、与ETF运作相关的风险

1、第三方机构服务风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理,存在以下风险:

(1)、申赎代理机构因多种原因,导致代理申购赎回业务受到限制、暂停或终止,由此影响对投资者的申购赎回服务。

(2)、登记结算机构可能调整结算制度,本基金的运作过程中涉及两个不同市场的登记结算机构,登记结算机构的各项结算制度如实施货银对付制度,对投资者基金份额、黄金现货合约及资金的结算方式发生变化,制度调整可能给投资者带来风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

(3)、深圳证券交易所、上海黄金交易所、登记结算机构、黄金经纪代理人、基金托管人及其他代理机构可能违约,导致基金或投资者利益受损的风险。

2、操作风险

相关当事人在业务各环节操作过程中,可能因内部制度存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致风险,例如,申购赎回清单编制错误、越权违规交易、资金清算操作错误、欺诈行为及交易错误等风险。

3、交收失败风险

本基金主要投资在上海黄金交易所进行,交收失败风险是指在现行上海黄金交易所资金清算及现货交易交割管理办法下,交易所清算部对部分信誉较高的会员客户的资金或现货状况不做交易前检查,可能发生对手方、黄金经纪代理人资金不足或货物不足而造成资金或黄金交收失败的风险。

4、技术风险

在本基金的投资、交易、服务与后台运作等业务过程中,可能因为技术系统的故障或差错导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、黄金经纪代理人、黄金交易所、深圳证券交易所、登记结算机构及销售代理机构等。

5、管理风险

基金管理人、基金托管人等相关当事人的业务发展状况、人员配备、管理水平与内部控制等对基金收益水平存在影响。因业务扩张过快、行业内过度竞争、对主要业务人员过度依赖等可能会产生影响投资者利益的风险。

6、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、黄金经纪代理人、黄金交易所、深圳证券交易所、登记结算机构和销售代理机构等可能因不可抗力无法正常工作,从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

一、基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

二、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

三、基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

(1) 自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

(1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

- 7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

第二十部分 基金合同的内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一) 基金份额持有人的权利、义务

1、基金份额持有人的权利：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 缴纳基金认购和用于认购基金的黄金现货实盘合约、应付申购对价和赎回对价及基金合同规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (5) 执行基金份额持有人大会的决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (7) 遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；
- (8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

(二) 基金管理人的权利、义务

1、基金管理人的权利：

- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
- (2) 依照法律法规和基金合同独立管理运用基金财产；
- (3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(4) 根据法律法规和基金合同的规定决定本基金的相关费率结构和收费方式，获得基金管理费，收取认购费、申购费、赎回费及其他事先核准或公告的合理费用以及法律法规规定的其他费用；

(5) 根据法律法规和基金合同的规定销售基金份额；

(6) 在本合同的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本合同的情况进行必要的监督。如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

(7) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议和有关法律法规对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(8) 更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(10) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(11) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益分配方案；

(12) 按照法律法规，代表基金行使因投资于黄金现货合约和其他证券所产生的权利；

(13) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(14) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(15) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(16) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(17) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务：

(1) 依法申请并募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行

证券投资；

- (6) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- (7) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (8) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；
- (9) 依法接受基金托管人的监督；
- (10) 编制季度、半年度和年度基金报告；
- (11) 采取适当合理的措施使计算开放式基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；
- (12) 计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- (14) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除基金法、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (15) 按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
- (16) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表、代表基金签订的重大合同及其他相关资料；
- (17) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (18) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其它义务。

(三) 基金托管人的权利和义务

1、基金托管人的权利：

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

(6) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

- (1) 安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 按规定开设基金财产的资金账户、黄金账户和证券账户；
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立；
- (6) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (7) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (8) 按照基金合同的约定，根据基金管理人的指令，及时办理清算、交割事宜；
- (9) 保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；
- (10) 根据法律法规及本合同的约定，办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (11) 对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (12) 保存基金份额持有人名册；
- (13) 复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (17) 按照法律法规监督基金管理人的投资运作；
- (18) 因过错违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- (19) 因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿，除法律法规另有规定外，基金托管人不承担连带责任；
- (20) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一) 本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或其合法的代理人组成。本基金的基金份额持有人享有平等的表决权，每一基金份额具有一票表决权。

本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出

席本基金的份额持有人大会并参与表决，其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

(二) 有以下情形之一时，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上（含 10%，下同）的基金份额持有人同意，应召开基金份额持有人大会：

- 1、终止基金合同；
- 2、转换基金运作方式；
- 3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、变更基金类别；
- 6、变更基金投资目标、范围或策略（法律法规或中国证监会另有规定的除外）；
- 7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序；
- 8、终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；
- 8、本基金与其他基金合并；
- 9、对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；
- 10、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(三) 有以下情形之一的，不需召开基金份额持有人大会：

- 1、调低基金管理费率、基金托管费率和其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式、调低赎回费率或收费方式；
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

6、经中国证监会允许，基金管理人、交易所和注册登记机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

6、基金管理人对本基金主要投资的黄金现货合约根据市场流动性情况的变化或其他情况进行调整；

7、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

（四）召集方式：

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（五）通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当于会议召开前 30 天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

1、会议召开的时间、地点、方式；

2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；

- 3、会议形式；
- 4、代理投票授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、授权委托书送达时间和地点；
- 5、会务常设联系人姓名、电话；
- 6、权益登记日；
- 7、出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- 8、如采用通讯表决方式，还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容；
- 9、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票结果。

（六）开会方式

1、会议方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。

通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定，但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

2、召开基金份额持有人大会的条件

（1）现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场开会的方式视为有效：

1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、身份证明和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证、代理人身份证明和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定；

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

（2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的 50%以上(含 50%);

4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表, 同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定;

5、会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件, 则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 25 个工作日后), 且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

(七) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

(1) 议事内容限为本条前述第(二)款规定的基金份额持有人大会召开事由范围内的事项。

(2) 基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案, 大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

a、关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系, 并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的, 应提交大会审议; 对于不符合上述要求的, 不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决, 应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

b、程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决, 需征得原提案人同意; 原提案人不同意变更的, 大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定, 并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 代表基金份额 10%以上(含 10%)的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案, 或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案, 未获得基金份额持有人大会审议通过, 就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议, 其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

(6) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后, 如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案, 应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

2、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

（八）表决

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

（2）一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

4、采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（九）计票

1、现场开会

（1）基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员（如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金管理人在出席会议的基金份额持有人中指定）共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对

大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证，不影响计票和表决结果。

(十) 生效与公告

1、基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3、基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

4、如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

(十一) 法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金合同解除和终止的事由、程序

(一) 基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。

2、变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

3、但如因相应的法律法规发生变动并属于本基金合同必须遵照进行修改的情形，或者基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的，可不经基金份额持有人大会决议，而经基金管理人和基金托管人同意修改后公布，并报中国证监会备案。

（二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；
- 3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

基金合同终止后，基金管理人和基金托管人有权依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关法律法规的规定，行使请求给付报酬、从基金财产中获得补偿的权利。

（三）基金财产的清算

1、基金合同终止，基金管理人应当按法律法规和本基金合同的有关规定组织清算组对基金财产进行清算。

2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止事由之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

3、清算程序

- （1）基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- （3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （7）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （8）对基金财产进行分配。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由

基金财产清算组优先从基金财产中支付。

5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

6、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

四、争议解决方式

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

(三) 除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

(一) 基金管理人（或简称“管理人”）

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

法定代表人：杨鹤

成立日期：1998 年 7 月 13 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字【26】号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.5 亿元人民币

经营范围：发起设立基金、基金管理及中国证监会批准的其他业务

存续期间：持续经营

(二) 基金托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金管理人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的各项投资品种的具体范围提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督。

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。本基金主要投资于黄金交易所的黄金现货合约，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为 AU99.99、AU99.95。本基金主要投资的黄金现货延期交收合约为 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。本基金可从事黄金现货租赁业务。

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。

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。

根据交易方式不同，金交所挂盘黄金合约包括：黄金现货实盘合约、黄金现货延期交收合约及其他经中国人民银行批准的合约。黄金现货实盘合约有 AU50g、AU100g、AU99.99、AU99.95、AU99.5；黄金现货延期交收合约有 AU（T+D）、AU（T+N1）、AU（T+N2）。黄金现货实盘合约和黄金现货延期交收合约均属于黄金现货合约。本基金主要投资的黄金现货实盘合约有 AU99.99、AU99.95。本基金主要投资的黄金现货延期交收合约有 AU（T+D）。基金管理人对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或其他情况进行调整，此调整无须召开持有人大会。

2、对基金投融资比例进行监督。

（1）本基金投资于黄金现货合约的资产比例不低于基金资产的 90%；

3、为对基金禁止从事的关联交易进行监督，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4、基金管理人向基金托管人提供其银行间债券市场交易的交易对手库，交易对手库由银行间交易会员中财务状况较好、实力雄厚、信用等级高的交易对手组成。基金管理人可以根据实际情况的变化，及时对交易对手库予以更新和调整，并通知基金托管人。基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手应符合交易对手库的范围。基金托管人对基金管理人参与银行间债券市场交易的交易对手是否符合交易对手库进行监督；

5、基金托管人对银行间市场交易的交易方式的控制按如下约定进行监督。

基金管理人应按照审慎的风险控制原则，对银行间交易对手的资信状况进行评估，控制交易对手的资信风险，确定与各类交易对手所适用的交易结算方式，在具体的交易中，应尽力争取对基金有利的交易方式。由于交易对手资信风险引起的损失，基金托管人不承担赔偿责任。

6、基金如投资银行存款，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，事先确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合上述名单进行监督；

(二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行复核。

(三) 基金托管人在上述第(一)、(二)款的监督和核查中发现基金管理人违反法律法规的规定、《基金合同》及本协议的约定，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函并改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应及时向中国证监会报告。

(四) 基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规、《基金合同》及本协议的规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》、本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

(五) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

三、基金管理人基金托管人的业务监督、核查

1、在本协议的有效期限内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍基金托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，基金管理人有权对基金托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

2、基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无正当理由未执行或延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反法律法规、《基金合同》及本协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

3、基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

（二）基金合同生效前募集资金的验资和入账

- 1、基金募集期满或基金管理人宣布停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含现券认购所募集的黄金实盘合约的市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定的，由基金管理人在法定期限内聘请具有从事相关业务资格的会计师事务所对基金进行验资，并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。
- 2、基金管理人应将属于本基金财产的全部资金划入在基金托管人处为本基金开立的基金银行账户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。

（三）基金的银行账户的开设和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的银行账户的开设和管理。
- 2、基金托管人以本基金的名义开设本基金的银行账户。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过本基金的银行账户进行。
- 3、本基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本基金的银行账户进行本基金业务以外的活动。
- 4、基金银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

（四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

（五）黄金交易编码、基金证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

- 1、基金托管人应当代表本基金，以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。基金管理人负责在上海黄金交易所为基金开立黄金交易

编码，基金托管人提供必要的协助。

2、本基金黄金交易编码、证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让本基金的证券账户，亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于办理基金托管人所托管的包括本基金在内的全部基金在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

（六）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行银行间债券市场债券和资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

（七）基金财产投资的有关有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人负责妥善保管。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

（八）与基金财产有关的重大合同及有关凭证的保管

基金托管人按照法律法规保管由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同及有关凭证。基金管理人代表基金签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给基金托管人。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。重大合同及有关凭证由基金管理人与基金托管人按规定各自保管至少 15 年。

五、基金资产净值计算与复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日该基金份额总数后的价值。

2、基金管理人应每开放日对基金财产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的该基金份额净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给基金托管人。基金托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给基金管理人，由基金管

理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《基金合同》规定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当基金资产的估值导致基金份额净值小数点后四位内发生差错时，视为基金份额净值估值错误。当基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当报中国证监会备案；当计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处理。

6、由于基金管理人对外公布的任何基金净值数据错误，导致该基金财产或基金份额持有人的实际损失，基金管理人应对此承担责任。若基金托管人计算的净值数据正确，则基金托管人对该损失不承担责任；若基金托管人计算的净值数据也不正确，则基金托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了基金财产或基金份额持有人的不当得利，且基金管理人及基金托管人已各自承担了赔偿责任，则基金管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补基金管理人承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于黄金交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

8、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

六、基金份额持有人名册的登记与保管

（一）基金份额持有人名册的内容

基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 3、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

（二）基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后 5 个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后 5

个工作日内向基金托管人提供。

（三）基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向中国证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的保管费给予补偿。

七、争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）基金管理人与基金托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决。但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

八、托管协议的效力

（一）基金管理人在向中国证监会申请发售基金份额时提交的基金托管协议草案，应经托管协议双方当事人的法定代表人或授权签字人签字并加盖公章，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会核准的文本为正式文本。

（二）本协议自双方签署之日起成立，自基金合同生效之日起生效。本协议的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（三）本协议自生效之日起对双方当事人具有同等的法律约束力。

（四）本协议正本一式陆份，协议双方各执贰份，上报中国证监会和中国银监会各壹份，每份具有同等法律效力。

第二十二部分 对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申赎代理机构提供。基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，以下是主要的服务内容。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改服务项目。

基金管理人提供的服务内容如下：

一、客户服务电话

客户服务中心自动语音系统提供每周七天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务，客户可以通过电话查询基金份额净值。同时，客服中心提供工作日每天 9:00-21:00、节假日（十一和春节除外）9:00-17:00 的电话人工服务。

全国统一客服热线：95105568（免长途话费）

二、网上客户服务中心

网上客户服务为投资者提供查询服务、资讯服务以及在线交流的平台。登陆网站后，投资者可以查询基金相关信息，享受资讯服务；投资者还可以查询热点问题及其解答，并提交投诉与建议。

公司网址：www.bosera.com

电子邮箱：service@bosera.com

三、客户投诉处理

投资者可以通过博时基金网站、客服中心 IVR 自动语音留言、客服中心电话人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人提供的服务进行投诉。投资者还可以通过发售代理机构、申赎代理机构的服务电话对该代理机构提供的服务进行投诉。

第二十三部分 招募说明书存放及查阅方式

招募说明书存放在基金管理人的办公场所，投资者可在办公时间查阅；投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。对投资者按此种方式所获得的文件及其复印件，基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（www.bosera.com）查阅和下载招募说明书。

第二十四部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- 一、中国证监会批准博时黄金交易型开放式证券投资基金募集的文件
- 二、《博时黄金交易型开放式证券投资基金基金合同》
- 三、《博时黄金交易型开放式证券投资基金托管协议》
- 四、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 五、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 六、关于申请募集博时黄金交易型开放式证券投资基金之法律意见书
- 七、中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(此页无正文)

博时基金管理有限公司

2014年8月1日