

1.



# 前海开源黄金交易型开放式证券投资 基金招募说明书 (20211214 更新)

基金管理人：前海开源基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

本基金经 2019 年 10 月 14 日中国证券监督管理委员会下发的证监许可[2019]1907 号文注册募集，基金合同已于 2020 年 4 月 29 日正式生效。

基金管理人保证本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注册，但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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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。

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、参与黄金 T+D 品种的风险、参与黄金出借的风险、基金份额交易价格折溢价相对股票类 ETF 可能较高的风险、参考基金份额参考净值(IOPV)决策的风险、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、业绩比较基准变更的风险、退市风险、投资者认购或申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、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，流动性风险，以及第三方机构服务的风险、管理风险、操作风险、技术风险、不可抗力风险等。

投资者进行网上、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；投资者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者以黄金现货实盘合约提交认购或申购申请将作失败处理。

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。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者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》、《基金合同》、基金产品资料概要。

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对本基金表现的保证。

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。基金管理人提醒投资者基金投资的“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。投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本招募说明书已经本基金托管人复核(不属于基金托管人法定复核责任范围且其不掌握相关信息的内容除外)，有关财务数据和净值表现截止日为 2021 年 9 月 30 日（未经审计）。

## 目 录

|                        |     |
|------------------------|-----|
| 一、绪言.....              | 4   |
| 二、释义.....              | 5   |
| 三、基金管理人.....           | 10  |
| 四、基金托管人.....           | 20  |
| 五、相关服务机构.....          | 22  |
| 六、基金的募集.....           | 25  |
| 七、基金合同的生效.....         | 26  |
| 八、基金份额折算与变更登记.....     | 27  |
| 九、基金份额的交易.....         | 28  |
| 十、基金份额的申购与赎回.....      | 30  |
| 十一、基金的投资.....          | 42  |
| 十三、基金资产的估值.....        | 50  |
| 十四、基金的收益分配.....        | 54  |
| 十五、基金的费用与税收.....       | 56  |
| 十六、基金的会计与审计.....       | 58  |
| 十七、基金的信息披露.....        | 59  |
| 十八、风险揭示.....           | 64  |
| 十九、基金的终止与清算.....       | 70  |
| 二十、基金合同的内容摘要.....      | 72  |
| 二十一、基金托管协议的内容摘要.....   | 86  |
| 二十二、对基金份额持有人的服务.....   | 95  |
| 二十三、其他应披露事项.....       | 97  |
| 二十四、招募说明书的存放及查阅方式..... | 99  |
| 二十五、备查文件.....          | 100 |

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）等有关法律法规的规定，以及《前海开源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”）的约定编写。

本招募说明书阐述了前海开源黄金交易型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指前海开源黄金交易型开放式证券投资基金；
- 2、基金合同：指《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
- 3、招募说明书或本招募说明书：指《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 4、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《前海开源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；
- 5、业务规则：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》（包括其不时修订）、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《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基金登记结算业务实施细则》（包括其不时修订）、中国证券登记结算有限责任公司、深圳证券交易所、基金管理人及基金销售机构发布的其他相关规则 and 规定；
- 6、基金份额发售公告：指《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金份额发售公告》；
- 7、上市交易公告书：指《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金上市交易公告书》；
- 8、中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 9、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会；
- 10、《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，并经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 2 月 17 日修订通过并于 2013 年 6 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订；
- 14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订；

- 15、元：指人民币元；
- 16、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；
- 17、基金管理人：指前海开源基金管理有限公司；
- 18、基金托管人：指中国建设银行股份有限公司；
- 19、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；
- 20、登记结算业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者账户的建立和管理、基金份额登记、基金交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等；
- 21、登记结算机构：指办理登记结算业务的机构。本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司和前海开源基金管理有限公司。其中，本基金认购份额的登记结算、场内份额的申购、赎回及上市交易等相关业务的登记结算由中国证券登记结算有限责任公司负责办理；本基金场外份额的申购、赎回等相关业务的登记结算由前海开源基金管理有限公司负责办理；
- 22、场内份额：指由中国证券登记结算有限责任公司办理份额登记结算业务的基金份额；
- 23、场外份额：指由基金管理人办理份额登记结算业务的基金份额；
- 24、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，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；
- 25、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及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；
- 26、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；
- 27、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；
- 28、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；
- 29、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人；
- 30、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月；
- 31、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；

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限；

33、工作日：指上海黄金交易所和深圳证券交易所的共同交易日；

34、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；

35、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；

36、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；

37、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转换为基金合同约定的对价资产的行为；

38、申购、赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告场内份额申购对价、赎回对价等信息的文件；

39、申购对价：指投资者申购本基金场内份额时，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；或投资者申购本基金场外份额时，按基金合同和招募说明书的规定应向基金管理人支付的现金；

40、赎回对价：指基金份额持有人赎回其持有的本基金场内份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给投资者的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；或基金份额持有人赎回其持有的场外份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书的规定应支付给投资者的现金；

41、组合证券：指在黄金交易所上市交易的黄金（Au）品种，为业绩比较基准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；

42、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；

43、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；

44、现金替代：指申购、赎回本基金场内份额的过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券的一定数量的现金；

45、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；投资者场内申购、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；

46、最小申购、赎回单位：指投资者申购、赎回本基金场内份额的最低数量，投资者申购、赎回的本基金场内份额应为最小申购、赎回单位的整数倍；

47、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场内份额的基金份额参考净值，简称 IOPV；

48、场内申赎：指投资者通过上海黄金交易所会员或通过深圳证券交易所会员等申购赎回代理机构分别采用现券、现金申购、赎回本基金场内份额的方式；

49、场外申赎：指投资者通过基金管理人直销机构或基金管理人指定的代理机构等销售机构采用现金申购、赎回本基金场外份额的方式；

50、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；

51、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；

52、预估现金差额：指由基金管理人估计并在 T 日申购、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；

53、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场内份额申购、赎回业务的销售机构；

54、联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，采用开放式运作方式的基金；

55、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；

56、直销机构：指前海开源基金管理有限公司；

57、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；

58、销售机构：指直销机构及本基金代销机构；

59、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；

60、巨额赎回：指本基金单个开放日，场外份额的净赎回申请（场外份额赎回申请份额总数加上场外份额转出申请份额总数后扣除场外份额申购申请份额总数及场外份额转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%；

61、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；

62、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”）；

63、黄金账户：指投资者在上海黄金交易所开立的交易账户；

64、开放日：指申购赎回代理机构或基金销售机构办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期；

65、T 日：指申购赎回代理机构或基金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；

66、T+n日：指T日起（不包括T日）的第n个工作日；

67、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；

68、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、其他各类有价证券、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；

69、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值；

70、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；

71、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；

72、收益评价日：指基金管理人计算本基金基金份额累计收益率与业绩比较基准累计收益率差额之日；

73、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；

74、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；

75、基金产品资料概要：指《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金基金产品资料概要》及其更新。

### 三、基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

- 1、名称：前海开源基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
- 3、设立日期：2013年1月23日
- 4、法定代表人：王兆华
- 5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]1751号
- 6、组织形式：有限责任公司
- 7、办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼
- 8、电话：0755-88601888 传真：0755-83181169
- 9、联系人：何凌
- 10、注册资本：人民币2亿元
- 11、存续期限：持续经营
- 12、股权结构：开源证券股份有限公司出资25%，北京市中盛金期投资管理有限公司出资25%，北京长和世纪资产管理有限公司出资25%，深圳市和合投信资产管理合伙企业(有限合伙)出资25%。

#### (二) 主要人员情况

##### 1、基金管理人董事会成员

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长兼总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事长，代任督察长。

龚方雄先生，荣誉董事长，宾夕法尼亚大学沃顿商学院金融经济学博士。国籍：中国香港。历任美国联邦储备银行经济学家，美国银行首席策略师、全球货币及利率市场策略部联席主管，摩根大通中国区研究部主管、首席策略师、首席大中华区经济学家、中国综合公司（企业）投融资主席，现任前海开源基金管理有限公司荣誉董事长。

王宏远先生，荣誉董事长，西安交通大学经济学硕士，美国哥伦比亚大学公共管理硕士，国籍：中国。历任深圳特区证券有限公司研究员，南方基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理，中信证券股份有限公司首席投资官、执行总经理（ED）、交易与衍生产品业务部行政负责人。现任前海开源基金管理有限公司荣誉董事长。

蔡颖女士，副董事长，硕士研究生，国籍：中国。历任南方证券广州分公司营业部电脑部主管、经纪业务部主管、电子商务部副经理，南方基金管理有限公司广州代表处首席代表、南方区域总部高级经理，鹏华基金管理有限公司华南营销中心（广州）副总经理、广州分公司总经理，曾任前海开源基金管理有限公司总经理、前海开源资产管理有限公司董事长。现任前海开源基金管理有限公司副董事长。

范镭先生，董事，本科学历，国籍：中国。历任中国建设银行武汉分行、华安保险北京分公司、交通银行天津分行、北京长和世纪资产管理有限公司投资总监。

秦亚峰先生，董事、总经理、固定收益投资决策委员会主席。清华大学硕士，中国社科院博士，国籍：中国。历任中国银行湖南分行信托咨询公司技术员，中国东方信托湖南证券营业部部门经理，银河证券湖南证券营业部部门经理，亚洲证券湖南证券营业部部门经理，华安财产保险股份有限公司资产管理中心副总经理、总经理，华安财产保险股份有限公司副总经理，华安财保资产管理有限责任公司总经理，华安汇富资本投资管理有限公司董事长，现任前海开源基金管理有限公司董事、总经理、固定收益投资决策委员会主席。

周新生先生，独立董事，中国工业经济学会副会长，管理学博士学位，经济学教授。国籍：中国。历任陕西财经学院助教、讲师、副教授、教授、工业经济系副主任、研究生部主任、MBA 中心主任、院长助理；曾任陕西省审计厅副厅长、长安银行监事长、民建陕西省委员会副主委；曾任第十二届全国政协委员。

樊臻宏先生，独立董事，国籍：中国。纽约大学 STERN 商学院商业管理博士学位。历任 ARGONAUT 资本管理公司（对冲基金）分析员、美林证券全球科技策略师、中国人寿资产管理公司国际业务部副总经理及项目部副总经理、北京春湖投资顾问有限公司总经理，天津汇通太和投资管理有限公司总经理。

Terence Culver 先生，独立董事，硕士学历。国籍：美国。历任哈佛大学国际发展研究所项目经理，联合国 GeSCI 组织全球新兴市场政府顾问及开发专家，哥伦比亚大学国际和公共事务学院副院长等职务，现任美国数字金融集团—DFG Fund 首席执行官、普通合伙人。

Samuel T. Lundquist 先生，独立董事，本科学历。国籍：美国。在美国宾夕法尼亚大学沃顿商学院先后工作 25 年，现任宾夕法尼亚大学沃顿商学院对外事务副院长。

## 2、基金管理人监事会成员

骆新都女士，监事会主席，经济学硕士，经济师，国籍：中国。历任民政部外事处处长、南方证券有限公司副总裁、南方基金管理有限公司董事长、监事会主席。现任前海开源基金管理有限公司监事会主席。

陆琦先生，监事，理学学士和工学硕士学位。国籍：中国。历任穆迪信息咨询有限公司研发工程师，项目研发组组长，南方基金风险管理部，2015 年 10 月加入前海开源基金，担任金融工程部总监。

傅智先生，监事，本科学历，注册会计师。国籍：中国。历任天健信德会计师事务所审计员、南方基金管理有限公司运作保障部总监助理、副总监、执行总监，现任前海开源基金管理有限公司基金核算部总监。

曾媛媛女士，经济学硕士。国籍：中国。曾任博时基金管理有限公司交易员。2014年4月加入前海开源基金管理有限公司，现任交易部总监。

汤力女士，硕士研究生。国籍：中国。历任中青国际出版集团法务部主任，汤森路透法律集团产品培训师，英大基金管理有限公司监察稽核部高级经理。2013年11月起加入前海开源基金管理有限公司，现担任监察稽核部总监。

刘艳女士，金融学硕士。国籍：中国。2006年8月至2013年9月任长城基金管理有限公司渠道总对总主管，2014年10月加入前海开源基金管理有限公司，曾任财富管理本部副总监，现任第三方及同业部总监。

崔宸龙先生，材料科学与工程博士研究生。国籍：中国。2016年11月至2017年8月任深圳市前海安康投资发展有限公司研究部研究员，2017年8月加盟前海开源基金管理有限公司，现任投资部基金经理。

李刚先生，管理学硕士。国籍：中国。先后任职于长江证券，任运营管理总部业务管理部主管、公司交易所产品创新小组秘书；曾任西部证券信用业务部高级经理、零售业务总部副总经理；曾任长江证券西安营业部副总经理兼投顾总监、深圳深南路营业部总经理。2020年加入开源证券，现任开源证券经纪业务总部总经理。

孙达先生，管理学硕士。国籍：中国。先后任职于中国铁路第五工程局，任土木工程师；曾任北京嘉恒基础设施投资有限公司，任工程部经理。现任北京长和世纪资产管理有限公司投资部总经理。

### 3、高级管理人员情况

王兆华先生，董事长，本科学历，国籍：中国。历任中国人民银行西安市分行职员，中国工商银行西安市开发区支行副行长、分行信贷处处长，华夏证券西安营业部总经理、华夏证券济南管理总部党委书记兼总经理、华夏证券总裁助理兼重庆分公司党委书记、总经理，华夏证券总裁助理，开源证券董事长兼总经理，现任前海开源基金管理有限公司董事长，代任督察长。

秦亚峰先生，董事、总经理、固定收益投资决策委员会主席。清华大学硕士，中国社会科学院博士，国籍：中国。历任中国银行湖南分行信托咨询公司技术员，中国东方信托湖南证券营业部部门经理，银河证券湖南证券营业部部门经理，亚洲证券湖南证券营业部部门经理，华安财产保险股份有限公司资产管理中心副总经理、总经理，华安财产保险股份有限公司副总经理，华安财保资产管理有限责任公司总经理，华安汇富资本投资管理有限公司董事长，现任前海开源基金管理有限公司董事、总经理、固定收益投资决策委员会主席。

何隹先生，副总经理、首席信息官、首席运营官。硕士研究生，国籍：中国。历任国信证券信息技术部经理，汉唐证券红岭中路营业部副总经理、深圳、东莞银证通负责人，华泰联合证券部门总经理，华林证券总裁助理。2016年6月加入前海开源基金管理有限公司，现担任前海开源基金管理有限公司副总经理、首席信息官、首席运营官。

曲扬先生，副总经理，权益投资决策委员会主席。清华大学计算机科学与技术系博士。曾任职南方基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理。2014年7月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司副总经理、权益投资决策委员会主席。

邱杰先生，副总经理，专户投资决策委员会主席、FOF投资决策委员会主席。北京大学经济学硕士。曾任职福建省财政厅、南方基金管理有限公司、建信基金管理有限公司。2014年2月加入前海开源基金管理有限公司，现任前海开源基金管理有限公司副总经理、专户投资决策委员会主席、FOF投资决策委员会主席。

#### 4、本基金基金经理

本基金历任基金经理为：谢屹先生，管理时间为2020年4月29日至2021年6月3日、梁溥森先生，管理时间为2020年5月14日至今、孔芳女士，管理时间为2021年6月3日至今。

梁溥森先生，中山大学硕士研究生。曾任招商基金基金核算部基金会计，2015年6月加入前海开源基金，现任公司指数化投资团队基金经理。2020年5月7日至今，任前海开源中证500等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2020年5月14日至今，任前海开源黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、2020年5月25日至今，任前海开源黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理、2020年8月12日至今，任前海开源沪深300指数型证券投资基金基金经理、2020年12月18日至今，任前海开源中证健康产业指数型证券投资基金基金经理、2020年12月18日至今，任前海开源MSCI中国A股指数型证券投资基金基金经理，梁溥森先生具备基金从业资格。

孔芳女士，中国国籍，北京语言大学金融学学士。2010年7月至2020年11月任职于中衍期货有限公司，历任研究员、产品经理、投资经理、投资咨询部主管等职务，2020年11月加盟前海开源基金管理有限公司，现任指数化投资团队基金经理。2021年6月3日至今，任前海开源黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、2021年6月3日至今，任前海开源黄金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理。孔芳女士具备基金从业资格。

#### 5、投资决策委员会成员情况

##### 权益投资决策委员会

权益投资决策委员会名单如下：曲扬、邱杰、吴国清、王霞、杨德龙、肖立强。曲扬为权益投资决策委员会主席，邱杰为权益投资决策委员会副主席，肖立强为权益投资决策委员会秘书。

### 固定收益投资决策委员会

固定收益投资决策委员会名单如下：秦亚峰、刘静、王旭巍、李炳智、史延、吴彦、林悦、晏建军。秦亚峰为固定收益投资决策委员会主席，刘静为固定收益投资决策委员会荣誉主席，王旭巍为固定收益投资决策委员会副主席，李炳智为固定收益投资决策委员会秘书。

### FOF 投资决策委员会

FOF 投资决策委员会名单如下：邱杰、曲扬、晏建军、杨德龙、覃璇、肖立强。邱杰为 FOF 投资决策委员会主席，曲扬为 FOF 投资决策委员会副主席，覃璇为 FOF 投资决策委员会秘书。

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、依法募集资金，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募集、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照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收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、按照规定召集基金份额持有人大会；

10、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；

11、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；

12、中国证监会规定的其它职责。

### （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》、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》等法律法规的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法行为的发生。

2、基金管理人的禁止行为：

（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）不公平地对待公司管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或职务之便为基金份额持有人以外的人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律法规以及中国证监会禁止的其他行为。

3、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，不从事以下活动：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反法律法规、基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或基金合同其他当事人的合法权益；
- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (8) 违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等非法手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (9) 贬损同行，以提高自己；
- (10) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (11) 以不正当手段谋求业务发展；
- (12) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (13) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 4、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) 不得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或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

#### **(五) 基金管理人的内部控制制度**

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，维护公司及公司股东的合法权益，本基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系。

##### 1、内部控制的总体目标



(1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展。

(3) 确保基金、公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

(4) 促进公司全体员工恪守职业操守，正直诚信，廉洁自律，勤勉尽责。

2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

(1) 健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运营成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

(6) 适时性原则。内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

3、内部控制体系

(1) 内部控制制度体系

公司制定了合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司内部控制大纲，它是公司制定各项规章制度的纲要和总揽；第二个层面是公司基本管理制度，包括风险控制制度、投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案制度、业绩评估考核制度和紧急应变制度；第三个层面是部门业务规章，是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等的具体说明；第四个层面是业务操作手册，是各项具体业务和管理工作的运行办法，是对业务各个细节、流程进行的描述和约束。它们的制订、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，每一层面的内容不得与其以上层面的内容相违背。公司重视对制度的持续检验，结合业务的发展、法规及监管环境的变化以及公司风险控制的要求，不断检讨和增强公司制度的完备性、有效性。

(2) 内部控制组织架构

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) 监察及风险控制委员会

作为董事会下的专业委员会之一，监察及风险控制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；向监察及风险控制委员会提交风险管理报告和风险管理建议。

## 4) 监察稽核部

监察稽核部负责对公司的基金运作、内部管理、系统实施和合法合规情况进行内部监督，形成意见上报总经理及督察长；对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见。

## 5) 风险管理团队

风险管理团队负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助。风险管理团队负责公司投资管理风险、信用风险、市场风险等日常风险管理工作，组织实施公司投资风险管理工作，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。

## 4、内部控制措施

### (1) 授权制度

公司的授权制度贯穿于整个公司活动。股东会、董事会、监事会和管理层必须充分履行各自的职权，健全公司逐级授权制度，确保公司各项规章制度的贯彻执行；各项经营业务和管理程序必须遵从管理层制定的操作规程，经办人员的每一项工作必须是在业务授权范围内进行。公司重大业务的授权必须采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。公司授权要适当，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

### (2) 公司研究业务

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

### (3) 基金投资业务

基金投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证基金投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

#### （4）交易业务

建立集中交易制度，投资指令通过交易部完成；建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；交易部应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度，确保各基金利益的公平；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对和存档保管；同时建立科学的投资交易绩效评价体系。

#### （5）基金会计核算

公司根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同基金、不同客户独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

#### （6）信息披露

公司建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。公司设立了信息披露负责人，并建立了相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

#### （7）监察稽核

公司设立督察长，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部开展监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性。公司明确了监察稽核部及内部各岗位的具体职责，严格制订了专业任职条件、操作程序和组织纪律。

监察稽核部强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，促使公司各项经营管理活动的规范运行。

公司董事会和管理层充分重视和支持监察稽核工作，对违反法律法规和公司内部控制制度的，追究有关部门和人员的责任。

### 5、基金管理人关于内部合规控制书的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

- 
- (2) 基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
  - (3) 基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：李申

联系电话：(021)6063 7102

#### 2、主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户运营处、托管应用系统支持处、合规监督处等 12 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2021 年一季度末，中国建设银行已托管 1097 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。截至目前，中国建设银行先后多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项，并在 2017、2019 及 2020 年分别荣获《亚洲银行家》

颁发的“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”以及“中国年度托管银行（大型银行）”奖项。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格检查，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### 2、监督流程

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

（3）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### (一) 销售机构

#### 1、现金申购、赎回代办证券公司（以下排序不分先后）

| 序号 | 代销机构         | 销售机构信息  |
|----|--------------|---|
| 1  | 申万宏源证券有限公司   | <p>申万宏源证券有限公司</p> <p>注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层</p> <p>办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层</p> <p>法定代表人：杨玉成</p> <p>联系人：曹晔</p> <p>电话：(021) 33389888</p> <p>传真：(021) 33388224</p> <p>电话委托：(021)962505</p> <p>客服电话：95523, 4008-895-523</p> <p>网址：www.swhysc.com</p> |
| 2  | 中信建投证券股份有限公司 | <p>中信建投证券股份有限公司</p> <p>注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼</p> <p>办公地址：北京市朝内大街 188 号</p> <p>法定代表人：王常青</p> <p>联系人：张颢</p> <p>电话：(010)85156398</p> <p>传真：(010)65182261</p> <p>客服电话：4008-888-108</p> <p>网址：www.csc108.com</p>  |
| 3  | 华泰证券股份有限公司   | <p>华泰证券股份有限公司</p> <p>注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号</p> <p>办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场</p> <p>法定代表人：张伟</p> <p>联系人：庞晓芸</p> <p>电话：0755-82492193</p> <p>传真：0755-82492962</p> <p>客服电话：95597</p> <p>网址：www.htsc.com.cn</p>                                       |

#### 2、黄金现券申购、赎回代办公司

| 序号 | 代销机构 | 销售机构信息 |
|----|------|--------|
|----|------|--------|

|   |              |  |
|---|--------------|--|
| 1 | 中国工商银行股份有限公司 | 中国工商银行股份有限公司<br>注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号<br>办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号<br>法定代表人：陈四清<br>联系人：杨菲<br>传真：(010)66107910<br>客服电话：95588<br>网址：www.icbc.com.cn                          |
| 2 | 交通银行股份有限公司   | 交通银行股份有限公司<br>住所：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号<br>办公地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号<br>法定代表人：任德奇<br>联系人：温从镭<br>客服电话：95559<br>网址：www.bankcomm.com                                    |
| 3 | 海通证券股份有限公司   | 海通证券股份有限公司<br>注册地址：上海市广东路 689 号<br>办公地址：上海市广东路 689 号<br>法定代表人：周杰<br>联系人：李笑鸣<br>电话：(021)23219000<br>客服电话：95553<br>网址：www.htsec.com  |
| 4 | 华泰证券股份有限公司   | 华泰证券股份有限公司<br>注册地址：江苏省南京市江东中路 228 号<br>办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场<br>法定代表人：张伟<br>联系人：庞晓芸<br>电话：0755-82492193<br>传真：0755-82492962<br>客服电话：95597<br>网址：www.htsc.com.cn |

(二) 登记机构

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：周明

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

负责人：俞卫锋

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

电话：021- 31358666

传真：021- 31358600

### **（五）会计师事务所和经办注册会计师**

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01

室

办公地址：中国(上海)黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 11 楼

首席合伙人：李丹

联系人：施翊洲

经办会计师：施翊洲、陈熹

电话：(021)23238888

传真：(021)23238800

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》和其他有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会 2019 年 10 月 14 日证监许可[2019]1907 号文注册募集。募集期自 2020 年 4 月 7 日至 2020 年 4 月 22 日，共募集有效认购份额 317,141,000.00 份，利息结转份额 25,441.00 份，合计 317,166,441.00 份，募集户数 3,629 户。

本基金为交易型开放式基金，基金存续期限为不定期。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同的生效

本基金合同于 2020 年 4 月 29 日正式生效。自基金合同生效日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《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 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时，从其规定。

## 八、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。

基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定公告。基金份额折算后的基金份额净值与折算基准日上海黄金交易所 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。除因尾数处理而产生的损益外，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响，无须召开基金份额持有人大会。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

基金份额折算的具体方法在基金份额折算公告中披露。

## 九、基金份额的交易

### （一）基金上市

根据有关规定，本基金合同生效后，具备上市条件，本基金自 2020 年 5 月 29 日起在深圳证券交易所上市交易。

### （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》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，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 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或因上述第 3 项原因向深圳证券交易所申请终止上市的，本基金将自终止上市之日起由交易型开放式基金变更为非上市的开放式基金或与联接基金合并。

### （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3位。若深圳证券交易所调整有关基金份额参考净值保留位数，本基金将进行相应调整。

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。

(六) 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同从其规定，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

(七) 若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，基金管理人可以在履行适当程序后增加相应功能。

(八) 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，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他交易所上市交易，而无需召开持有人大会审议。

(九) 法律法规、监管部门或深圳证券交易所对上市交易另有规定的，从其规定。

## 十、基金份额的申购与赎回

### （一）基金份额的申购与赎回

本基金的场内份额的申购赎回包括两种方式：现券申赎方式和现金申赎方式。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等申购赎回代理机构，分别采用现券或现金，申购赎回本基金场内份额。

未来在条件允许的情况下，基金管理人可以开通本基金的场外申购、赎回等业务，场外申购赎回的适用条件、业务办理时间、业务规则、申购赎回原则、申购赎回费用等相关事项届时将另行约定并公告。

#### 1、申购和赎回场所

本基金场内份额的申购、赎回业务由申购赎回代理机构办理。

##### （1）现券申赎

场内申赎模式下，本基金现券申赎的申购赎回代理机构主要为具有基金销售业务资格的上海黄金交易所会员。

##### （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销售业务资格的深交所会员等场内机构进行。

投资者应当按申购赎回代理机构指定的方式办理本基金场内份额的申购和赎回。

本基金管理人将在开始场内份额的申购、赎回业务前公告申购赎回代理机构名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理机构。

#### 2、申购和赎回的开放日及时间

##### （1）开放日及开放时间

通常情况下，投资者可办理场内份额申购、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。本基金场内份额现金申购、赎回业务的具体办理时间为开放日的 9:30-11:30 和 13:00-15:00。本基金场内份额现券申购、赎回业务的具体办理时间为开放日的 9:30-11:30 和 13:00-15:00。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停场内份额申购、赎回时除外。具体办理时间见相关业务公告。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、上海黄金交易所或深圳证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，或出于具体业务运作的需要，基金管理人可视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

##### （2）申购、赎回开始日及业务办理时间

本基金场内份额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。

本基金场内份额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。

在确定场内份额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 个工作日在规定媒介上公告。

本基金已于 2020 年 5 月 29 日开放日常申购赎回业务。

### 3、申购与赎回的原则

(1) 本基金场内份额的申购、赎回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) 本基金场内份额的申购、赎回申请提交后不得撤销；

(3) 本基金场内份额的申购、赎回应遵守深圳证券交易所、上海黄金交易所及中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定；

(4) 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 个工作日在规定媒介上公告。

### 4、申购与赎回的程序

#### (1) 账户备案

场内份额现券申赎模式下，投资者首次提交本基金场内份额的现券申购、赎回申请前必须先按照上海黄金交易所的相关规定进行账户备案。投资者完成账户备案后方可参与本基金场内份额的现券申购、赎回，否则申请将被拒绝。

本基金场内份额现券申购、赎回方式下账户备案的具体要求及办理流程见申购赎回代理机构的相关业务规则。

场内份额现金申赎方式下，投资者无须进行账户备案。

#### (2) 申购与赎回申请的提出及确认

投资者提交场内份额的申购申请时，须根据申购赎回清单备足相应数量并符合要求的申购对价，否则申购申请失败。投资者提交场内份额的赎回申请时，须根据申购赎回清单备足相应数量并符合要求的赎回对价，否则赎回申请失败。

申购赎回代理机构受理投资者场内份额的申购、赎回申请并不代表申购、赎回申请成功。场内份额申购、赎回的确认以登记结算机构的确认结果为准。

### 5、申购和赎回的清算交收与登记

本基金场内份额申购、赎回过程中涉及的申购对价、赎回对价的清算交收适用深圳证券交易所、登记结算机构、上海黄金交易所相关业务规则和各参与方相关协议的有关规定。

#### (1) 场内份额的现券申赎方式

场内份额的现券申赎模式下，投资者 T 日的申购或赎回申请受理后，上海黄金交易所办理黄金现货实盘合约的过户，登记结算机构根据上海黄金交易所黄金现货实盘合约过户的结果，于 T 日日终完成基金份额的变更登记。

基金管理人与申购赎回办理机构在 T+1 日进行现金差额的交收。

如果深圳证券交易所、登记结算机构、上海黄金交易所和基金管理人在清算交收时发现



不能正常履约的情形，则依据深圳证券交易所、登记结算机构、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进行处理。深圳证券交易所、登记结算机构、上海黄金交易所和基金管理人可在法律法规允许的范围内，对场内份额现券申购与赎回的程序进行调整。

## （2）场内份额的现金申赎方式

场内份额的现金申赎模式下，投资者 T 日申购申请成功后，正常情况下，登记结算机构于 T 日日终为投资者办理基金份额与现金替代等的交收，于 T+3 日内办理现金差额的清算，并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。

场内份额的现金申赎模式下，投资者 T 日赎回成功后，正常情况下，登记结算机构于 T 日日终办理基金份额的注销，于 T+3 日内办理现金差额的清算，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。赎回现金替代款将自有效赎回申请之日起 7 个工作日内划往基金份额持有人账户。

如果深圳证券交易所、登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据深圳证券交易所、登记结算机构相关业务规则和参与各方相关协议的有关规定进行处理。深圳证券交易所、登记结算机构和基金管理人可在法律法规允许的范围内，对场内份额现金申购与赎回的程序进行调整。

基金管理人和登记机构可在法律法规允许的范围内，对上述申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，并在开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上予以公告。

## 6、申购和赎回的数量限制

（1）投资者现券申购、赎回本基金场内份额，须按现券申购、赎回的最小申购、赎回单位的整数倍提交申请。投资者现金申购、赎回本基金场内份额，须按现金申购、赎回的最小申购、赎回单位的整数倍提交申请。

目前，本基金场内份额的最小申购、赎回单位为 30 万份。

投资者提出场内份额的现券申购申请前须按 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。

（2）基金管理人可根据市场情况，对场内份额现券申赎、场内份额现金申赎的最小申购、赎回单位进行调整，基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定提前 3 个工作日在规定媒介上公告。

（3）基金管理人可设定本基金场内份额的现券申购份额上限、现金申购份额上限、现券赎回份额上限及现金赎回份额上限，以对当日的现券申购、现金申购总规模或现券赎回、现金赎回总规模进行控制，并分别在申购、赎回清单中公告。

（4）基金管理人可设定单个投资者累计持有的本基金场内份额上限。

（5）当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人有权采取设定单一投资者申购份额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停

基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

(6) 基金管理人可根据上海黄金交易所的相关业务规则、基金运作情况、市场情况和投资者需求等因素，在法律法规允许的情况下，调整场内份额申购和赎回的数额限制并及时公告。

## 7、申购与赎回的对价和费用

(1) 场内份额的现券申购、赎回方式下，申购对价是指投资者申购本基金的场内份额时应交付的组合证券、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回本基金的场内份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金差额及其他对价。在场内份额的现金申购、赎回方式下，申购对价是指投资者申购本基金的场内份额时应交付的现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回本基金的场内份额时，基金管理人应交付给投资者的现金替代、现金差额及其他对价。

(2) 本基金场内份额申购、赎回方式下，申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的本基金场内份额数额确定。

申购、赎回清单由基金管理人编制。T 日场内份额的现券申购、赎回清单由基金管理人提供给上海黄金交易所。T 日场内份额的现金申购、赎回清单由基金管理人提供给深圳证券交易所。T 日的申购、赎回清单在当日申购、赎回开放时间前公告。

(3) 场内份额申购、赎回方式下，申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金。

(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。如遇特殊情况，基金管理人可以适当延迟计算或公告。

(5) 若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

(6) 本基金场内份额的现券申购、赎回方式下，过户费等相关费用按上海黄金交易所的相关规定执行。

## 8、申购赎回清单的内容与格式

(1) 现券申购赎回清单的内容

1) 申购赎回清单的内容

T 日现券申购赎回清单公告内容包括基金代码、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，预估现金差额可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 × 1000 克) ÷ 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 日投资者申购、赎回基金份额时，需按 T+1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。T 日现金差额的计算公式为：

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 × Au99.99 现货实盘合约 T 日收盘价 × 1000 克) ÷ 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 × Au99.95 现货实盘合约 T 日收盘价 × 1000 克) ÷ 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在投资者申购时，若现金差额为正数，则投资者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，则投资者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在投资者赎回时，若现金差额为正数，则投资者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，则投资者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                   |         |
| 基金代码                       |         |
| 申购赎回方式                     |         |
| <b>T-1 日信息内容</b>           |         |
| 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）   |         |
| 最小申购赎回单位资产净值（单位：人民币元）      |         |
| 基金份额净值（单位：人民币元）            |         |
| <b>T 日信息内容</b>             |         |
| Au99.99 预估现金差额（单位：人民币元/千克） |         |
| Au99.95 预估现金差额（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）       |         |
| 当天累计可赎回的基金份额上限（单位：份）       |         |
| 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、赎回   |         |
| 是否接受 Au99.95 现货实盘合约申购、赎回   |         |
| <b>黄金现货合约信息内容</b>          |         |
| 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，通过上海黄金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。

## （2）现金申购赎回清单的内容

### 1) 申购赎回清单的内容

T 日现金申购赎回清单内容包括：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，投资者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者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者收取欠缺的差额。

##### 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者办理申购基金份额与现金替代交收后的下一工作日（即 T+1 日）内，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黄金现货实盘合约的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若 T+1 日内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（包括买入价格与交易费用）加上按照 T+1 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者或投资者应补交的款项。

登记结算机构为投资者办理赎回基金份额交收后的下一工作日（即 T+1 日）内，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黄金现货实盘合约的实际卖出金额（扣除相关费用），确定应支付投资者的赎回现金替代款；若 T+1 日内未能卖出全部被替代的黄金现货实盘合约，则以卖出的被替代黄金现货实盘合约的实际卖出金额（扣除相关费用）加上 T+1 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，确定支付投资者的赎回现金替代款。

#### 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：

$T$  日现金差额= $T$  日最小申购、赎回单位的资产净值—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  $T$  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。 $T$  日投资者以现金申购、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。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者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，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者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，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

#### 7) 申购赎回清单的格式

$T$  日现金申购赎回清单格式举例如下：

|                        |  |
|------------------------|--|
| <b>基本信息</b>            |  |
| <b>最新公告日期</b>          |  |
| <b>基金名称</b>            |  |
| 基金管理公司名称               |  |
| 基金代码                   |  |
| 拟合指数代码                 |  |
| 申购赎回方式                 |  |
| <b>T-1 日信息内容</b>       |  |
| 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）        |  |
| <b>T 日信息内容</b>         |  |
| 预估现金差额（单位：人民币元）        |  |
| 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（单位：份）   |        |         |        |          |        |        |         |
| 当天累计可赎回的基金份额上限（单位：份）   |        |         |        |          |        |        |         |
| <b>T 日组合信息内容</b>       |        |         |        |          |        |        |         |
| 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     |          |        | 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。

8) 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。

## （二）拒绝或暂停申购的情形及处理

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申请。基金管理人可视情况同时暂停或拒绝场内份额和场外份额的申购，也可只拒绝或暂停其中一种或部分份额或方式的申购。

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法受理投资者的申购申请；
- 2、基金申购赎回开放时间内，上海黄金交易所、深圳证券交易所等交易场所交易时间非正常停市或临时停市；或上海黄金交易所黄金现货合约暂停交易；
- 3、深圳证券交易所、上海黄金交易所、申购赎回代理机构、登记结算机构、基金管理人等因异常情况无法办理申购，或者因异常情况申购、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，或其他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、申购赎回清单或者 IOPV 计算错误、申购赎回清单编制错误；
- 7、当日申购申请达到基金管理人设定的申购份额上限的情况；
- 8、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- 9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；
- 10、法律法规、深圳证券交易所、上海黄金交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

在发生上述情形（除第 7、8 项外）之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并依法公告。

### （三）暂停赎回或延缓支付赎回款或赎回对价的情形及处理

在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款或赎回对价。基金管理人可视情况同时对场内份额和场外份额赎回实施暂停或延缓支付赎回款或赎回对价，也可只针对其中一种或部分份额或方式实施暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款或赎回对价。

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法受理投资者的赎回申请；
- 2、基金申购赎回开放时间内，上海黄金交易所、深圳证券交易所等交易场所交易时间非正常停市或临时停市；或上海黄金交易所黄金现货合约暂停交易；
- 3、深圳证券交易所、上海黄金交易所、申购赎回代理机构、登记结算机构、基金管理人等因异常情况无法办理赎回，或者因异常情况申购、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、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 5、无法按时公布基金份额净值、申购赎回清单或者 IOPV 计算错误、申购赎回清单编制错误；
- 6、当日场内份额赎回申请达到基金管理人设定的赎回份额上限的情况；
- 7、场外份额连续两个或两个以上的开放日发生连续巨额赎回；
- 8、接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- 9、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估



值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付赎回对价或暂停接受基金赎回申请；

10、法律法规、深圳证券交易所、上海黄金交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

在发生上述情形（除第 6、8 项外）之一，基金管理人应根据有关规定在规定媒介上刊登暂停赎回的公告。在暂停赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并依法公告。对于已经确认的赎回申请，基金管理人应足额支付，也可以根据所发生的情形的实际影响延缓支付赎回款项或赎回对价。

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。

#### （四）基金份额的登记

投资者通过认购、二级市场买入、场内申购的基金份额的登记结算业务由中国证券登记结算有限责任公司负责办理。

#### （五）其他

1、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货实盘合约，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。在条件允许时，在不违反法律法规规定且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，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。

2、基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和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。

3、场外份额开放申购、赎回后，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、赎回模式，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。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

5、在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行基金份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

#### （六）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。

#### （七）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法律、法规、行业相关业务规定或基金管理人的业务规则，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。

(八) 基金管理人可在法律法规允许的范围内，在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

## 十一、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，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。

### （二）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（包括现货实盘合约、现货延期交收合约等）、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（但须符合中国证监会相关规定）。

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%，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。

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）。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。本基金可从事黄金现货租赁业务。

### （三）投资策略

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。本基金参与 AU（T+D）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。

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，取得租赁收入，并要求对方按时或提前归还黄金现货合约。本基金将谨慎考察黄金现货合约借入方的资信情况，根据基金的申购赎回情况、黄金的市场供求情况，决定黄金现货合约租赁的期限、借出的黄金现货合约占基金资产净值的比例及租赁利率等。

基金管理人参与黄金租赁，需依据《上海黄金交易所实物租借管理办法》规定，遵守审慎经营原则，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，有效防范和控制风险，切实维护基金财产的安全和基金持有人的利益。

### （四）业绩比较基准

上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率。

如果上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约终止交易或者 Au99.99 现货实盘合约流动性

发生重大改变，或者国内黄金交易所出现其它代表性更强、投资者认同度更高的黄金基准价格时，若变更业绩比较基准对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制机构变更、指数更名等事项），基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在征得基金托管人同意后，变更本基金的业绩比较基准，并报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

### （五）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。

### （六）投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（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）本基金持有买入 AU（T+D）价值不超过基金资产净值的 10%；持有买入 AU（T+D）与现货实盘合约价值之和，不超过基金资产净值的 100%。本基金持有卖出 AU（T+D）价值不超过基金持有的现货实盘合约价值的 10%。本基金因申购赎回而被动超标的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

（3）每个交易日日终，本基金扣除 AU（T+D）需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金 1 倍的现金。

（4）本基金若参与黄金租赁，需满足以下限制：

1) 黄金租赁的对手方仅限于上海黄金交易所金融类会员中的银行和分类评级在 A 类以上的证券公司。

2) 本基金参与出借的黄金现货合约不超过基金资产净值的 30%，出借期限最长不超过 12 个月，平均剩余期限不超过 6 个月。出借给单个交易对手的黄金现货合约不超过基金资产净值的 10%。本基金因净值变动而被动超标的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

3) 本基金发生流动性问题时，基金管理人有权提前终止租赁协议，要求交易对手方归还黄金现货合约。

（5）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因黄金市场、证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（6）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第（5）、（6）项情形之外，因黄金市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （5）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；
- （6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

### （七）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。

### （八）其他

在不违反法律法规规定的情况下，本基金可与基金管理人管理的其他资产以公平的市场价格进行相互交易。

### （九）基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2021 年 9 月 30 日（未经审计）。

## 1. 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)         | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -             | -             |
|    | 其中：股票             | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -             |
|    | 其中：债券             | -             | -             |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | 54,433,263.40 | 99.07         |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 313,197.54    | 0.57          |
| 8  | 其他资产              | 200,036.10    | 0.36          |
| 9  | 合计                | 54,946,497.04 | 100.00        |

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合  
无。

2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合  
无。

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
无。

## 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细  
无。

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

无。

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

| 序号 | 贵金属代码   | 贵金属名称   | 数量(克)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1  | Au99.99 | Au99.99 | 150,310 | 54,433,263.40 | 99.30        |

注：本基金本报告期末仅持有以上贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

无。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

10.3 本期国债期货投资评价

无。

11. 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 200,000.00 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 36.10      |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 200,036.10 |

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

#### (十) 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

#### 前海开源黄金交易型开放式证券投资基金

| 阶段                   | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2020.4.29-2020.12.31 | -0.19% | 0.97%     | 3.44%      | 1.00%         | -3.63% | -0.03% |



|                     |        |       |        |       |        |        |
|---------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2021.1.1-2021.9.30  | -7.70% | 0.77% | -7.14% | 0.78% | -0.56% | -0.01% |
| 2020.4.29-2021.9.30 | -7.88% | 0.87% | -3.95% | 0.89% | -3.93% | -0.02% |

## 十二、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的黄金现货合约、其他各类有价证券、银行存款本息和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

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、黄金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记结算机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记结算机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 十三、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （二）估值对象

基金所拥有的黄金现货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值方法

#### 1、黄金现货合约的估值

（1）上海黄金交易所挂盘的黄金现货实盘合约，以其估值日在上海黄金交易所挂盘的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）上海黄金交易所挂盘的黄金现货延期交收合约，以其估值日在上海黄金交易所挂盘的结算价估值。估值当日无结算价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

#### 2、其他有价证券的估值方法

其他有价证券按有关规定估值。

#### 3、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 4、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或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，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。

### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数

量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

### （五）估值错误的处理

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。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或销售机构、或投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

#### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得

不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## (六) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商一致的，基金应当暂停估值；

4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## (七) 基金净值的确认

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和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净值予以公布。

## (八) 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

由于证券交易所、上海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而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十四、基金的收益分配

### （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业绩比较基准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、本基金场内份额与场外份额的收益分配均采用现金方式；
- 2、每一类别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业绩比较基准同期累计收益率达到 0.5% 以上，方可对超额收益进行分配；
- 4、自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配；
- 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、业绩比较基准同期累计收益率。

基金收益评价日本基金相对业绩比较基准的超额收益率=基金累计收益率-业绩比较基准同期累计收益率。

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%；业绩比较基准累计收益率为当日上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价与基金上市前一日上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价之比减去 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、公告与实施

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，基金管理人在 2 日内在规定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日。



## 十五、基金的费用与税收

### （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》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 7、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 8、基金份额持有人大会费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 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、证券账户开户费用、黄金账户开户费用、银行账户维护费用；
- 12、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。

### （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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—12 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况，在履行必要的程序后，调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在规定媒介上刊登公告。

### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十六、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月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托管协议约定的方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、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。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在规定媒介公告。

## 十七、基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，从其规定。

### (二) 信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本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符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《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。

(三) 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

(四) 本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### (五) 公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

(1) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益事项的法律文件。

(2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应

应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

(3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

(4) 基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。

## 2、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规定媒介上。

## 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认备案文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。

## 4、基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金管理人确定基金份额折算日，并提前将基金份额折算日公告登载于规定媒介上。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

基金份额拆分的有关公告事项比照基金份额折算办理。

## 5、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在深圳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，将基金份额上市交易公告书登载在规定媒介上。

## 6、基金净值信息

《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在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 7、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 8、基金份额申购、赎回清单公告

在开始办理基金场内份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过基金管理人网站公告当日的申购、赎回清单。

#### 9、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

《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、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### 10、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和规定网站上。

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下列事件：

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- (2) 《基金合同》终止、基金清算；
- (3) 转换基金运作方式、基金合并；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

(5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

(6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

(7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

(8) 基金募集期延长或提前结束募集；

(9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

(10) 基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

(11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

(12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

(13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

(14) 基金收益分配事项；

(15) 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

(17) 本基金开始办理申购、赎回；

(18) 本基金变更业绩比较基准；

(19) 本基金场外份额发生巨额赎回并延期办理；

(20) 本基金场外份额连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(21) 本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

(22) 本基金调整最小申购、赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

(23) 基金份额实施分类或类别发生变化；

(24) 本基金暂停上市、恢复上市或终止上市；

(25) 本基金推出新业务或服务；

(26) 基金份额的折算；

(27) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(28) 基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

## 11、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基

基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，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和基金上市交易的证券交易所。

#### 12、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### 13、清算报告

基金合同终止情形出现的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 14、中国证监会规定的其他信息。

### **（六）信息披露事务管理**

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择披露信息的报刊。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

### **（七）信息披露文件的存放与查阅**

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所和基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。



## 十八、风险揭示

### （一）本基金的特定风险

#### 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。导致跟踪偏离风险的主要因素可能包括：

（1）本基金的日常支出包括管理费，托管费，以及基金因黄金现货合约交易、结算、仓储以及在投资者申购、赎回基金份额过程中因黄金现货实盘合约的过户所产生的费用（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）以及其他证券交易费用。上述费用因素可能导致本基金长期业绩低于业绩比较基准表现；

（2）投资者申购本基金场内份额时，本基金接受投资者以Au99.95或Au99.99现货实盘合约提出的申购申请；在投资者赎回基金份额时，本基金可支付Au99.95或Au99.99现货实盘合约作为赎回对价。即，本基金投资组合可能由Au99.95和Au99.99现货实盘合约等共同构成，与业绩比较基准存在一定差异。即本基金投资组合与业绩比较基准的结构差异可能导致基金表现与业绩比较基准的偏离；

（3）若本基金开始办理场内份额与场外份额的现金申购、赎回，投资者以现金申购、赎回方式申购或赎回本基金场内份额或场外份额时将带来一定的现金流投资或变现需求，即本基金可能代理投资者买卖黄金现货合约，由此可能产生相应的交易费用和冲击成本，导致本基金投资组合面临一定程度的跟踪偏离风险。

#### 3、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

由于本基金基金份额在二级市场的实时价格主要由市场供求关系决定。因此，尽管投资者可通过一、二级市场之间的套利机制缩小基金份额二级市场交易价格相对基金份额净值的折溢价，本基金二级市场价格与基金份额净值之间仍可能存在折溢价风险。

#### 4、参与黄金T+D品种的风险

本基金可以参与黄金T+D品种的投资，黄金T+D是指本基金以支付保证金的形式进行交易、当日无负债方式进行结算的合约，本基金可以选择合约成交当日交割，也可以延期交割。参与黄金T+D品种可能存在保证金不足等造成持有合约被强行平仓的风险。

#### 5、参与黄金出借的风险

本基金可以参与黄金出借业务，该业务存在交易对手信用风险，即若业务对手方破产或未到期归还等额同质黄金，则需要追索债务且可能无法获得全部或部分债权所产生的风险。

#### 6、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。交易时间不一致可能导致基金份额二级市场收盘价格与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。

#### 7、参考基金份额参考净值（IOPV）决策的风险

基金管理人或本基金委托的第三方机构根据基金管理人提供的计算依据及计算方法，每个交易日实时计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。实时的基金份额参考净值（IOPV）与实时的基金份额净值可能存在差异，基金管理人或第三方机构在计算IOPV时也可能出现错误，投资者参考其进行投资决策可能达到预期目标。

#### 8、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，投资者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。

#### 9、业绩比较基准变更的风险

根据基金合同的规定，如果上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约终止交易或者 Au99.99 现货实盘合约流动性发生重大改变，或者国内黄金交易所出现其它代表性更强、投资者认同度更高的黄金基准价格时，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，在征得基金托管人同意后，变更本基金的业绩比较基准，无需召开基金份额持有人大会。如业绩比较基准变更，本基金的投资组合可能会有调整，以反映新的业绩比较基准的风险收益特征，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

#### 10、退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

#### 11、投资者认购或申购失败的风险

(1) 如投资者在提交实物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，则实物认购申请失败。

(2) 如投资者通过申购赎回代理机构提出场内份额实物申购申请时未完成账户备案，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，则场内份额实物申购申请失败。

(3) 如投资者提出场内份额现金申购申请时，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，则场内份额现金申购申请失败。

(4) 本基金还可能在场内份额实物申购赎回清单和场内份额现金申购赎回清单中就以实物申购方式申购的场内份额和以现金申购方式申购的场内份额分别设定申购份额上限。对于以实物申购方式提交的场内份额申购申请，如果一笔新的场内份额申购申请被确认成功，会使本基金场内份额当日申购份额超过实物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场内份额申购申请，如果一笔新的场内份额申购申请被确认成功，会使本基金场内份额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) 如果投资者或申购赎回代理机构应付资金不足或出现违约，投资者的申购申请也可能失败。

#### 12、投资者赎回失败的风险

(1) 如果投资者在提交实物赎回场内份额申请时未完成账户备案，则实物赎回场内份

额的申请失败。

(2) 如投资者通过申购赎回代理机构提出场内份额实物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，则场内份额实物赎回申请失败；如投资者通过基金管理人提出实物赎回场内份额的申请时所持有的符合要求的基金份额不足，则场内份额实物赎回申请失败。

(3) 如投资者提出场内份额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，则场内份额现金赎回申请失败。

(4) 本基金还可能在场内份额实物申购赎回清单和场内份额现金申购赎回清单中就以实物赎回方式赎回的场内份额和以现金赎回方式赎回的场内份额分别设定赎回份额上限。对于以实物赎回方式提交的场内份额赎回申请，如果一笔新的场内份额赎回申请被确认成功，会使本基金场内份额当日赎回份额超过实物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场内份额赎回申请，如果一笔新的场内份额赎回申请被确认成功，会使本基金场内份额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。

### 13、不同申购赎回模式下交易和结算规则存在差异的风险

本基金场内份额的实物申购、赎回和场内份额的现金申购、赎回遵循不同的登记结算规则，具体业务办理时间及办理条件或有差异。

(1) 申购、赎回业务办理条件不同：就目前而言，仅有无法开立上海黄金交易所黄金账户的投资者方可以现金方式申购、赎回本基金场内份额。

(2) 申购、赎回业务办理程序不同：投资者参与本基金场内份额的现金申购、赎回不需要进行账户备案，而投资者首次参与本基金场内份额的实物申购、赎回前，需通过销售机构进行账户备案。

(3) 申购、赎回交易规则不同：以实物申购、赎回的场内份额和以现金申购、赎回的场内份额有着不同的申购对价和赎回对价，其交易和结算规则也有较大差异。

### 14. 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，适时调整本基金各类基金份额的交易规则。本基金基金份额交易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，与投资者的交易习惯或有一定差异。

## 15、其他特定风险

本基金主要投资于上海黄金交易所挂牌交易的黄金现货合约，同时在深圳证券交易所上市交易，涉及到黄金交易所、证券交易所两个市场。本基金的申购赎回方式、申购赎回办理机构、登记结算和清算方式、业务规则、投资品种等产品细节与传统的ETF有较大差异，基金管理人和各市场参与主体涉及相关业务的处理能力、经验、系统等有待验证，从而导致本基金的运作可能受到影响而带来风险。

### （二）流动性风险

#### 1、流动性风险评估

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（包括现货实盘合约、现货延期交收合约等）、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（但须符合中国证监会相关规定）。一般情况下，上述投资标的流动性较好，但不排除在特定阶段、特定市场环境下特定投资标的出现流动性较差的情况。由于黄金现货合约流动性不足等原因可能导致基金无法按预期进行建仓以及无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。如当黄金现货实盘合约流动性不足或黄金现货延期交收合约投资成本更低时，本基金也可适当投资于黄金现货延期交收合约，以期有效控制本基金的流动性风险。

#### 2、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金备用流动性风险管理工具包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值以及证监会认定的其他措施。暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价等工具的情形、程序见招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”之“暂停赎回或延缓支付赎回款或赎回对价的情形及处理”的相关规定。若本基金暂停赎回申请，投资者在暂停赎回期间将无法赎回其持有的基金份额。若本基金延缓支付赎回对价，赎回对价支付时间将后延，可能对投资者的资金安排带来不利影响。暂停基金估值的情形、程序见招募说明书“十三、基金资产的估值”之“暂停估值的情形”的相关规定。若本基金暂停基金估值，一方面投资者将无法知晓本基金的基金份额净值，另一方面基金将暂停接受申购赎回申请或延缓支付赎回对价，将导致投资者无法申购或赎回本基金，或赎回对价支付时间将后延，可能对投资者的资金安排带来不利影响。

3、对ETF基金投资人而言，ETF可在二级市场进行买卖，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

### （三）其他风险

#### 1、第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

（1）受多种因素影响，申购赎回办理机构代理申购、赎回业务可能受到限制、暂停或终止，从而影响投资者申购、赎回。

(2) 上海黄金交易所、证券交易所、证券登记结算机构、申购赎回办理机构、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、管理风险与操作风险

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。

#### 3、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、证券交易所、上海黄金交易所、登记结算机构及申购赎回办理机构等。

#### 4、不可抗力

(1) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产遭受损失。

(2) 基金管理人、基金托管人、证券交易所、上海黄金交易所、登记结算机构和申购赎回办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、使投资者和持有人无法及时查询权益、进行日常交易以致利益受损。

## 十九、基金的终止与清算

### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金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。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### （二）基金转换运作方式或者与其他基金合并

基金转换运作方式或者与其他基金合并，应当按照法律法规及基金合同规定的程序进行。实施方案若未在基金合同中明确约定，应当经基金份额持有人大会审议通过。基金管理人应当提前发布提示性通知，明确有关实施安排，说明对现有基金份额持有人的影响以及基金份额持有人享有的选择权，并在实施前预留至少二十个开放日或者交易日供基金持有人做出选择。

### （三）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （四）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告;

(5) 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;

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7) 对基金剩余财产进行分配。

#### **(五) 清算费用**

清算费用是指基金财产清算小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小组优先从基金财产中支付。

#### **(六) 基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案, 将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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。

#### **(七) 基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告, 基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上, 并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### **(八) 基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 二十、基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (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) 依法申请赎回或转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书（更新）等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 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；
- (5) 在其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；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 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。

#### (二) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金

财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记结算机构办理基金登记结算业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 为基金的利益行使因基金财产投资于黄金现货合约及其他证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券、申请和办理黄金现货合约租借等业务；

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

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户等业务的规则；

(17) 委托符合基金服务机构条件的第三方机构办理本基金的交易、清算、估值、结算等业务；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，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、赎回和登记结算事宜；

(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、谨慎勤勉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) 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；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、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，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 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；

(12) 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保密，不向他人泄露；

(13) 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；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

(15) 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；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 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；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(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合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行

为承担责任；

(23)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;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;募集期间已经过户的黄金现货实盘合约将退还给投资者;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)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。

### (三)基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、黄金账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算;

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

(2)设立专门的基金托管部门,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)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,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4)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,不得委托第三人托管基金财产;

(5)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;

(6)按规定开设基金财产的资金账户、黄金账户和证券账户等投资所需账户,按照《基

金合同》及《托管协议》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 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予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 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对价；

(15) 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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《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管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(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。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额（包括场内份额和场外份额）拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会未设日常机构。

### （一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）终止《基金合同》；

- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式(法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外)；
- (5) 调整基金管理人、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；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被证券交易所终止上市的除外；
- (14) 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。

2、在不违背法律法规和基金合同的约定，以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或调整收费方式；
- (3) 因相应的法律法规、上海黄金交易所、深圳证券交易所或登记结算机构的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 在不违反法律法规的情况下，制定有关场外份额申购、赎回、转换、非交易过户等相关业务规则，并适时开通场外份额的申购和赎回；
- (6) 基金管理人、深圳证券交易所、登记结算机构、上海黄金交易所和代销机构在法律法规、《基金合同》规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、非交易过户等业务的规则（包括但不限于场内份额、场外份额开放时间的调整，交易规则的调整等）；
- (7) 在不违反法律法规的情况下，调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组

成，增加新的申购对价、赎回对价，或调整场内份额申购赎回清单的内容，调整场内份额申购赎回清单计算和公告时间或频率；

(8) 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；

(9) 基金推出新业务或服务；

(10) 变更业绩比较基准；

(11) 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，增设新的份额类别、暂停或停止办理场外份额申购赎回业务；

(12) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《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。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、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，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（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，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%）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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项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，单独或合计代表基金份额 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。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、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## (三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份

额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、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效力。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会等基金合同约定的方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(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，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- (1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关



提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下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；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(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，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

(4) 上述第(3)项中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代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记结算机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用纸质、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

5、如果参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于在权益登记日基金总份额的 50%，则召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月后、六个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人参加，方可召开。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

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。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权

其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、与其他基金合并，应以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，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。

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。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）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和代理人中选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共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，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选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(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) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，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（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并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，不影响计票和表决结果。

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。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、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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议。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、基金托管人均有约束力。

### （九）关于本基金的联接基金所持本基金份额行使表决权的方式

如果本基金推出联接基金，鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，联接基金的持有人可以凭所持有的联接基金份额行使与本基金相关的持有人权利，如本基金基金份额持有人大会召集权、直接参加本基金基金份额持有人大会的表决权。计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人的参会份额数和票数按权益登记日联接基金所持有的本基金的基金份额、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折算。

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。

(十) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的或法律法规增加新的持有人大会机制的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改、

调整或补充，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金合同变更、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基金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。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

#### （二）基金转换运作方式或者与其他基金合并

基金转换运作方式或者与其他基金合并，应当按照法律法规及基金合同规定的程序进行。实施方案若未在基金合同中明确约定，应当经基金份额持有人大会审议通过。基金管理人应当提前发布提示性通知，明确有关实施安排，说明对现有基金份额持有人的影响以及基金份额持有人享有的选择权，并在实施前预留至少二十个开放日或者交易日供基金持有人做出选择。

#### （三）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

#### （四）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对基金财产进行估值和变现;
- (4) 制作清算报告;
- (5) 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;
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (7) 对基金剩余财产进行分配。

#### (五) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小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小组优先从基金财产中支付。

#### (六) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案, 将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

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。

#### (七) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告, 基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上, 并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### (八) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意, 因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的, 任何一方当事人均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁, 仲裁的地点为北京市, 仲裁裁决是终局的, 并对各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间, 基金合同当事人应恪守各自的职责, 继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务, 维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

### 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》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十一、基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：前海开源基金管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道7006号万科富春东方大厦22楼

邮政编码：518040

法定代表人：王兆华

成立日期：2013年1月23日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]1751号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### （二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

### 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，对基金投资范围、

投资对象进行监督。《基金合同》明确约定基金投资风格或投资品种选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于投资品种选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

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（包括现货实盘合约、现货延期交收合约等）、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（但须符合中国证监会相关规定）。

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%，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。

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）。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。本基金可从事黄金现货租赁业务。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

（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%；

（2）本基金持有买入 AU（T+D）价值不超过基金资产净值的 10%；持有买入 AU（T+D）与现货实盘合约价值之和，不超过基金资产净值的 100%。本基金持有卖出 AU（T+D）价值不超过基金持有的现货实盘合约价值的 10%。本基金因申购赎回而被动超标的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

（3）每个交易日日终，本基金扣除 AU（T+D）需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金 1 倍的现金。

（4）本基金若参与黄金租赁，需满足以下限制：

1）黄金租赁的对手方仅限于上海黄金交易所金融类会员中的银行和分类评级在 A 类以上的证券公司。

2）本基金参与出借的黄金现货合约不超过基金资产净值的 30%，出借期限最长不超过 12 个月，平均剩余期限不超过 6 个月。出借给单个交易对手的黄金现货合约不超过基金资产净值的 10%。本基金因净值变动而被动超标的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

3）本基金发生流动性问题时，基金管理人有权提前终止租赁协议，要求交易对手方归还黄金现货合约。

（5）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因黄金市场、证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；



(6) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

除上述第(5)、(6)项情形之外，因黄金市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

(四) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与上海黄金交易所市场进行监督。

(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及

时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(六) 基金托管人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监督和核查。

(七) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《基金合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

(八) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或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律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九) 若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、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，由此造成的损失由基金管理人承担。

(十) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

(一) 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括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。

(二) 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、未执行或无故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《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定时，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给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 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。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户，与基金管理人共同在上海黄金交易所基金的名义开立黄金账户。
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. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或登记结算机构扣收结算费和账户维护费等费用）。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

7. 除依据法律法规和《基金合同》的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### （二）基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集认购款项应存于基金认购专用账户。该账户由基金管理人或基金管理人委托的登记结算机构开立并管理。
2. 基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集到的属于基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### （三）基金银行账户的开立和管理

1. 基金托管人应以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

2. 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任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3. 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

### （四）基金黄金账户的开立和管理

#### 1. 黄金账户的开立

基金管理人与基金托管人共同在上海黄金交易所以基金的名义开立黄金账户。账户预留印鉴为基金托管人为本基金刻制的印章。

基金黄金账户的开立和使用，仅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未经对方同意擅自转让该账户，亦不得使用该账户进行本基金业务以外的活动。

#### 2. 交易结算

基金管理人负责为本基金资产开立独立的资金结算专用账户，并代表本基金完成与上海黄金交易所的清算、结算工作。

#### 3. 资产的保管

基金黄金账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

在获取黄金账户当日持仓余额及交易回报数据的前提下，基金托管人通过对上海黄金交易所开立的黄金账户内的资产进行核对来履行保管职责，因上海黄金交易所自身原因造成资产损失的除外。基金管理人负责基金上海黄金交易所资金结算专用账户以及交易保证金和清算准备基金的保管。

本基金上海黄金交易所资金结算专用账户仅能用于支付本基金在上海黄金交易所清算款和相关费用以及向基金托管人为本基金开立的银行账户划回清算款，不得向其他任何账户划付资金。

基金管理人和基金托管人任何一方均不得办理黄金实物的出、入库业务。

### （五）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2. 基金证券账户的开立和使用，仅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未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户

进行本基金业务以外的活动。

3. 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责, 账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

证券账户开户费由本基金财产承担。此项开户费由基金管理人先行垫付, 待托管产品开始运营后, 基金管理人可向基金托管人发送划款指令, 将代垫开户费从本产品托管资金账户中扣还基金管理人。账户开立后, 基金托管人应及时将证券账户开通信息通知基金管理人。

4. 基金托管人以基金托管人的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, 并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作, 基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务, 涉及相关账户的开立、使用的, 按有关规定开设、使用并管理; 若无相关规定, 则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### (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; 基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定, 以本基金的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户, 持有人账户和资金结算账户, 并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### (七) 其他账户的开立和管理

1. 在本托管协议订立日之后, 本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时, 如果涉及相关账户的开设和使用, 由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定, 开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的, 从其规定办理。

#### (八) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库, 也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库, 保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让, 按基金管理人和基金托管人双方约定办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间由于基金托管人的过错而导致的损坏、灭失, 由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任。

### （九）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为《基金合同》终止后 15 年。

## 五、基金资产净值计算和会计复核

### （一）基金资产净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，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。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

### （二）基金资产净值的复核

基金管理人应每工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或《基金合同》的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括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由基金结算登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，保存期不少于 20 年。基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 20 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、基金托管协议的变更、终止

### (一) 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更应报中国证监会备案。

### (二) 基金托管协议终止出现的情形

1. 《基金合同》终止;
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他基金托管人接管基金资产;
3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他基金管理人接管基金管理权;
4. 发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 二十二、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金投资人提供一系列的客户服务。基金管理人将根据基金投资人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）短信、邮件信息发送服务

基金管理人为基金投资人提供手机短信和电子邮件的信息定制服务，基金投资人可根据需要，通过基金管理人客服热线或官方网站订制、修改或取消该服务。

1、手机短信服务可提供的定制内容包括基金净值、基金交易确认、分红确认、月末账户余额等信息。

2、电子邮件服务可提供的定制内容包括基金净值、基金交易确认、分红确认、月末账户余额等信息。

3、除发送基金投资人定制的上述信息外，基金管理人会不定期向留有手机号码和电子邮箱地址的基金投资人发送节日及生日问候、产品推广等信息。若基金投资人不需要接收到该类信息，可通过基金管理人客服热线取消该项服务。

4、手机短信依托于外部通讯服务商发送，电子邮件通过互联网进行信息传送，基金管理人根据服务规则发送相关信息，但不对信息的送达做出承诺和保证。

### （二）客户服务中心（CALL-CENTER）电话服务

呼叫中心人工座席每个交易日（8：30-17：00）为基金投资人提供服务，客服热线服务内容包括业务咨询、信息查询、服务投诉、信息定制、资料修改等专项服务。

客服热线：4001-666-998

### （三）电子查询服务

基金投资人可通过基金管理人电子查询系统（网上查询系统、微信查询系统和 APP 查询系统）完成基金账户的查询业务。

官方网站：[www.qhkyfund.com](http://www.qhkyfund.com)

官方微信号：qhkyfund

### （四）投诉受理服务

基金投资人可以拨打基金管理人客服热线或以书信、电子邮件等方式，对基金管理人和



销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，基金管理人承诺在 3 个工作日之内对基金投资人的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，基金管理人将在顺延到下 1 个工作日进行回复。

客服邮箱：service@qhkyfund.com

（五）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，可通过上述方式联系本公司。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十三、其他应披露事项

(一) 前海开源基金管理有限公司(以下简称“本公司”)的从业人员在前海开源资产管理有限公司(以下简称“前海开源资管公司”或“子公司”)兼任董事、监事及领薪情况如下:

本公司谢劲松先生兼任前海开源资管公司董事长;

本公司王雅琴女士兼任前海开源资管公司董事;

本公司汤力女士兼任前海开源资管公司监事;

上述人员均不在前海开源资管公司领薪。本公司除上述人员以外未有从业人员在前海开源资管公司兼任职务的情况。

(二) 2021年01月23日至2021年10月27日披露的公告:

|  |
|--|
| 2021-10-27 前海开源黄金交易型开放式证券投资基金 2021 年第 3 季度报告                   |
| 2021-10-27 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第三季度报告提示性公告                |
| 2021-09-06 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与建设银行费率优惠活动的公告                   |
| 2021-08-31 前海开源黄金交易型开放式证券投资基金 2021 年中期报告                       |
| 2021-08-31 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年中期报告提示性公告                  |
| 2021-08-28 前海开源基金管理有限公司关于旗下基金参与工商银行费率优惠活动的公告                   |
| 2021-08-21 前海开源基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告                      |
| 2021-08-04 关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过天风证券股份有限公司办理定投业务起点金额的公告         |
| 2021-07-21 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第二季度报告提示性公告                |
| 2021-07-21 前海开源黄金交易型开放式证券投资基金 2021 年第 2 季度报告                   |
| 2021-07-06 关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过上海联泰基金销售有限公司办理定投业务起点金额的公告       |
| 2021-06-29 关于前海开源基金管理有限公司旗下基金根据信息披露办法修改基金合同和托管协议的公告            |
| 2021-06-05 前海开源黄金交易型开放式证券投资基金基金经理变更公告                          |
| 2021-06-03 关于调整前海开源旗下部分证券投资基金通过诺亚正行基金销售有限公司办理定投业务起点金额的公告       |
| 2021-04-29 前海开源基金管理有限公司关于终止与深圳市小牛基金销售有限公司合作关系的公告               |
| 2021-04-28 前海开源基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金通过珠海盈米基金销售有限公司办理业务最低限额的公告 |
| 2021-04-22 前海开源黄金交易型开放式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告                   |

|   |
|---|
| 2021-04-22 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第一季度报告提示性公告 |
|---|

|  |
|--|
| 2021-03-31 前海开源黄金交易型开放式证券投资基金 2020 年年度报告 |
|--|

|   |
|---|
| 2021-03-31 前海开源基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告提示性公告 |
|---|

## 二十四、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书按相关法律法规，存放在基金管理人、基金托管人和基金销售机构等的住所，投资者可在办公时间免费查阅；也可在支付工本费后在合理时间内获取本招募说明书复印件或复印件，但应以招募说明书正本为准。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十五、备查文件

### （一）备查文件包括：

- 1、中国证监会准予注册前海开源黄金交易型开放式证券投资基金募集的文件
- 2、《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金基金合同》
- 3、《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、注册登记协议
- 8、中国证监会要求的其他文件

### （二）备查文件的存放地点和投资者查阅方式：

- 1、存放地点：《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。
- 2、查阅方式：投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

前海开源基金管理有限公司

2021年12月14日