

华安易富黄金交易型开放式证券投资基金 上市交易公告书

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2013年7月29日

公告日期：2013年7月24日

目 录

一、重要声明与提示	1
二、基金概览	1
三、基金的募集与上市交易	2
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	5
五、基金主要当事人简介	6
六、基金合同摘要	10
七、基金财务状况	10
八、基金投资组合	12
九、重大事件揭示	14
十、基金管理人承诺	14
十一、基金托管人承诺	14
十二、备查文件目录	15
附件：基金合同摘要	15

一、重要声明与提示

华安易富黄金交易型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2013年6月21日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》及华安基金管理有限公司网站(www.huaan.com.cn)上的《华安易富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”）。

二、基金概览

- 1、基金名称：华安易富黄金交易型开放式证券投资基金。
- 2、基金简称：华安黄金易（ETF）。
- 3、基金二级市场交易简称：黄金ETF。
- 4、基金二级市场交易代码：518880。
- 5、基金现金申购、赎回简称：黄金申赎。
- 6、基金现金申购、赎回代码：518881
- 7、基金黄金现货合约申购、赎回代码：518880。
- 8、截至公告日前两个工作日即2013年7月22日基金份额总额：1,208,486,400份（未经份额折算）。
- 9、截至公告日前两个工作日即2013年7月22日基金份额净值：1.006元（未经份额折算）。

- 10、本次上市交易份额：1,208,486,400份（未经份额折算）。
- 11、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 12、上市交易日期：2013年7月29日。
- 13、基金管理人：华安基金管理有限公司。
- 14、基金托管人：中国建设银行股份有限公司。
- 15、现金申购赎回业务办理机构（即“申购赎回代办证券公司”，简称“一级交易商”或“代办证券公司”）：国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

- 1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可【2013】771号文。
- 2、基金运作方式：交易型、开放式。
- 3、基金合同期限：不定期。
- 4、发售日期：本基金自2013年6月24日至2013年7月12日公开发售。其中，网下现金认购的日期为2013年6月24日至2013年7月12日，网下黄金现货合约认购的日期为2013年6月24日至2013年7月12日，网上现金认购的日期为2013年7月10日至2013年7月12日。
- 5、发售价格：1.00 元人民币。
- 6、发售期限：网下现金发售15个工作日，网下黄金现货合约发售15个工作日，网上现金发售3个工作日。
- 7、发售方式：投资者可选择网上现金认购、网下黄金现货合约认购和网上现金认购3种方式。

8、发售机构

(1) 直销机构

投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购和网下黄金现货合约认购。

(2) 代销机构

本基金网下现金发售代理机构包括：德邦证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、厦门证券有限公司、国都证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、齐鲁证券有限公司、国元证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、国海证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司。

本基金网上现金发售代理机构为具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。

(二) 基金合同生效

本基金自2013年6月24日起向社会公开募集，截至2013年7月12日募集工作已顺利结束。经安永华明会计师事务所有限公司验资，此次募集的有效净认购金额为人民币1,208,440,500元（含所募集黄金现货合约市值），认购资金在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币45,900元。本次募集认购资金及其产生的利息已于2013年7月18日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户，所募集黄金现货合约已于2013年7月18日由上海黄金交

易所办理过户。

本次募集有效认购户数为9,134户，按照每份基金份额1.00元人民币计算，设立募集期间募集（含所募集黄金现货合约市值）及利息结算的基金份额共计1,208,486,400份，已全部计入本基金基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

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》以及《华安易富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”）、《华安易富黄金交易型开放式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2013年7月18日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（三）基金份额折算

根据本基金基金合同和招募说明书的有关规定，本基金管理人确定2013年7月24日为华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金份额折算日，折算后的基金份额净值将与2013年7月24日上海黄金交易所挂盘交易的黄金现货实盘合约Au99.99收盘价的百分之一基本一致。

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，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

基金份额折算后，本基金本次上市交易份额数额将相应发生调整，基金管理人将就其具体事宜进行必要公告。

（四）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所上证基字[2013]145号。

2、上市交易日期：2013年7月29日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：黄金ETF。

5、基金二级市场交易代码：518880。投资者在上海证券交易所各会员单位

证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

6、基金现金申购、赎回简称：黄金申赎。

7、基金现金申购、赎回代码：518881。本基金现金申购赎回业务的办理机构为经上海证券交易所确认的申购赎回代办证券公司，投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金的现金申购和现金赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的现金申购、赎回。目前本基金的一级交易商包括：国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司。

8、基金黄金现货合约申购、赎回代码：518880。本基金黄金现货合约申购、赎回业务的办理机构为经上海黄金交易所确认的会员单位，投资应当在本基金指定的会员单位办理黄金现货合约申购、赎回业务。

9、本次上市交易份额：1,208,486,400份（未经份额折算）。

10、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

11、本基金将以2013年7月25日的基金份额净值作为上市首日（即2013年7月29日）的开盘参考价。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至公告日前两个工作日即2013年7月22日，本基金份额持有人户数为9,134户，平均每户持有的基金份额为132,306份。

（二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即2013年7月22日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为680,424,400份，占基金总份额的56.30%；个人投资者持有的基金份额为528,062,000份，占基金总份额的43.70%。

（三）前十名基金份额持有人的情况

截至公告日前两个工作日即2013年7月22日，前十名基金份额持有人的情况如下表（未经份额折算）。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例（%）
1	国泰君安证券股份有限公司	200,000,000	16.55%
2	山金金控资本管理有限公司	120,032,400	9.93%
3	平安证券有限责任公司	40,010,800	3.31%
4	招商证券股份有限公司	40,000,000	3.31%
5	中信证券股份有限公司	40,000,000	3.31%
6	西南证券股份有限公司	40,000,000	3.31%
7	中信建投证券股份有限公司	35,000,000	2.90%
8	光大证券股份有限公司	30,000,000	2.48%
9	上海证券有限责任公司	30,000,000	2.48%
10	张仲文	20,000,000	1.65%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、法定代表人：李勍
- 3、总经理：李勍
- 4、注册资本：1.5亿元人民币
- 5、住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层
- 6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字【1998】20号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：310000000062071
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

9、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
上海国际信托有限公司	20%

持股单位	持股占总股本比例
上海电气（集团）总公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

10、内部组织结构及职能

公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会。

董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由九名董事组成，其中五家股东单位分别推荐一名董事，公司管理层推荐一名，另三名为独立董事。独立董事人数占董事会总人数的1/3，超过单一股东派出的董事人数。董事会下设风险控制、战略规划和人事薪酬等三个专业委员会。

监事会由八名监事组成，其中三名监事为公司职工代表，由公司职工民主选举和罢免。其余成员由股东会选举和罢免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。

公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。

公司组织架构以公司发展战略为导向而建立，主要采用管理扁平、分工明确的职能制结构，新增业务部分（如财富管理中心）采用灵活高效的事业部制，设有投资研究、市场营销、运营及后台、风险控制等四大板块共25个部门以及1个香港全资子公司。

11、人员情况：

截至2013年6月30日，公司目前共有员工303人，主要来自国内外证券公司等金融机构，其中85%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。

12、信息披露负责人：冯颖

电话：（021）38969720

13、基金管理业务情况简介：

截至2013年6月30日，华安基金管理有限公司旗下共管理1只封闭式基金和38

只开放式基金，资产规模达782.63亿元人民币。旗下管理的基金包括：华安安顺封闭、华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、上证180ETF、华安国际配置混合、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安上证180ETF联接、华安动态灵活配置混合、华安行业轮动股票、华安香港精选股票、上证龙头ETF、华安上证龙头ETF联接、华安稳固收益债券、华安升级主题股票、华安可转债债券、华安科技动力股票、华安信用四季红债券、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安双月鑫短期理财债券、华安逆向策略股票、华安安心收益债券、华安日日鑫货币、华安纯债债券、华安7日鑫债券、华安信用增强债券、华安深证300指数（LOF）、华安沪深300指数分级、华安标普石油指数（QDII-LOF）、华安保本混合、华安双债添利债券和华安安信消费股票。

14、本基金基金经理

许之彦先生：理学博士，CQF(国际数量金融工程师)，10年证券、基金从业经验。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师、风险管理与金融工程部总经理，现任指数投资部高级总监。2008年4月至2012年12月担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009年9月起同时担任华安上证180ETF及其联接基金的基金经理。2010年11月至2012年12月担任华安上证龙头企业ETF及其联接基金的基金经理。2011年9月起同时担任华安深证300指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2013年7月起同时担任本基金的基金经理。

徐宜宜：CFA，FRM，波士顿学院工商管理硕士，复旦大学计算机学士，8年基金从业经历。曾在美国道富全球投资工作，担任量化分析师/对冲基金基金经理助理等职位。2011年加入华安基金管理有限公司，2011年5月起至2012年12月止担任上证龙头ETF及上证龙头ETF联接基金的基金经理，自2012年3月起担任华安标普全球石油指数基金基金经理。2013年7月起同时担任本基金的基金经理。

（二）基金托管人

- 1、名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
- 2、住所：北京市西城区金融大街25号
- 3、办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
- 4、法定代表人：王洪章
- 5、成立时间：2004年9月17日
- 6、组织形式：股份有限公司
- 7、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
- 8、存续期间：持续经营
- 9、基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
- 10、联系人：田青
- 11、联系电话：(010) 6759 5096
- 12、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、QFII、企业年金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2012年9月30日，中国建设银行已托管267只证券投资基金。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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续三年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖。

（三）一级交易商

目前，本基金一级交易商名单如下：国泰君安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公

司、招商证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司。

(四) 基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16层

办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

执行事务合伙人：吴港平

电话：(021) 22288888

传真：(021) 22280000

联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、蒋燕华

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

(一) 基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金管理人承担，不从基金资产中列支。

(二) 基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三) 基金资产负债表

本基金截至2013年7月22日的资产负债表如下：

资 产	本期末 2013年7月22日
资 产：	
银行存款	1, 000, 000. 00

结算备付金	624,361,662.97
存出保证金	10,000.00
交易性金融资产	590,353,128.00
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
商品现货合约投资	590,353,128.00
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	78,970.95
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,215,803,761.92
负债和所有者权益	本期末
	2013年7月22日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	66,251.60
应付托管费	13,250.32
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-

递延所得税负债	-
其他负债	8,527.20
负债合计	88,029.12
所有者权益：	
实收基金	1,208,486,400.00
未分配利润	7,229,332.80
所有者权益合计	1,215,715,732.80
负债和所有者权益总计	1,215,803,761.92

注：报告截止日 2013 年 7 月 22 日，基金份额净值 1.006 元，基金份额总额 1,208,486,400.00 份。

八、基金投资组合

截至2013年7月22日，本基金的投资组合情况如下：

（一）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	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	商品现货合约投资	590,353,128.00	48.56
	其中：黄金现货合约	590,353,128.00	48.56
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	625,361,662.97	51.44

7	其他各项资产	88,970.95	0.01
8	合计	1,215,803,761.92	100.00

(二) 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

(三) 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明细

本基金本报告期末未持有股票。

(四) 期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(五) 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

(六) 投资组合报告附注

1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	78,970.95
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,970.95

4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

2013年7月19日发布了华安易富黄金交易型证券投资基金基金合同生效公告。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。

(二) 根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，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，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、备查文件目录

- (一) 中国证监会核准华安易富黄金交易型证券投资基金设立的文件
- (二) 《华安易富黄金交易型证券投资基金基金合同》
- (三) 《华安易富黄金交易型证券投资基金托管协议》
- (四) 《华安易富黄金交易型证券投资基金招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 中国证监会要求的其他文件

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务

(一)基金管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号，上海国金中心二期31、32层

法定代表人：李勍

成立时间：1998年6月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5亿元

存续期限：持续经营

联系电话：(021)38969999

(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：王洪章

成立时间：2004年9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

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机构等监管部门批准的其他业务

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

存续期间：持续经营

(三)基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

(四)基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1.依法申请并募集基金，办理基金备案手续；

- 2.自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- 3.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 4.根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- 5.依照有关规定行使因基金财产投资于黄金现货合约和证券所产生的权利；
- 6.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、转托管等业务的规则，制定收益分配方案，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- 7.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 8.在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- 9.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申请和办理黄金租借、黄金质押以及基金作为融资融券标的证券等相关业务；
- 10.自行担任或选择、更换登记结算机构，获取基金份额持有人名册，并对登记结算机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 11.选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- 12.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；
- 13.在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 14.依法召集基金份额持有人大会；
- 15.法律法规和基金合同规定的其他权利。

(五)基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

- 1.依法募集基金，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.计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购和赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10.按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12.编制季度、半年度和年度基金报告；

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，不得泄露基金投资计划、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，不得向他人泄露；

15.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；

16.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；

17.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；

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者实施其

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合法权益，应当承担赔偿责任，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.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23.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；

24.执行生效的基金份额持有人大会决议；

25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26.依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于黄金现货合约和证券所产生的权利；

27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(六)基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1.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收入；

2.监督基金管理人对本基金的投资运作；

3.自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4.在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

6.依法召集基金份额持有人大会；

7.按规定取得基金份额持有人名册资料；

8.法律法规和基金合同规定的其他权利。

(七)基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- 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.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；
- 4.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和证券账户；
- 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应予保密，不得向他人泄露；
- 8.对基金财务会计报告、半年度和年度基金报告出具意见，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；
- 9.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 10.按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 11.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 12.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值；
- 13.按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 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对价；
- 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.因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19.参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.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业监督管理机构，并通知基金管理人；

21.执行生效的基金份额持有人大会决议；

22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23.建立并保存基金份额持有人名册；

24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(八)基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9.法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

(九)基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1.遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

2.交纳基金认购、申购对价及法律法规和基金合同所规定的费用；

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及其他基金份额持有人合法权益的活动；

5.执行生效的基金份额持有人大会决议；

6.返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

7.法律法规和基金合同规定的其他义务。

(十)本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

(一)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具有同等的投票权。

(二)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)转换基金运作方式，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；

(3)变更基金类别，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；

(4)变更基金投资目标、投资范围，法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外；

(5)变更基金份额持有人大会程序；

(6)更换基金管理人、基金托管人；

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

(8)本基金与其他基金的合并；

(9)基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(10)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；

(11)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(12)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2.出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合

同，不需召开基金份额持有人大会：

- (1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2)法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (4)经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；
- (5)基金管理人、证券交易所、上海黄金交易所、登记结算机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (6)证券交易所、上海黄金交易所、登记结算机构在法律法规规定的范围内调整本基金的交易、申购、赎回、清算、结算效率；
- (7)在不违反法律法规的情况下，调整或增加基金的申购赎回方式，调整申购对价、赎回对价组成；
- (8)在不违反法律法规的情况下，增加、减少、调整基金份额类别设置；
- (9)在不违反法律法规的情况下，调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间或频率；
- (10)变更业绩比较基准、调整业绩比较基准计算依据或计算方法；
- (11)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (12)对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重大变化；
- (13)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；
- (14)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(三)召集人和召集方式

1.除法律法规或本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%以上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，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

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。

(四)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.基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1)会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2)会议拟审议的主要事项；
- (3)会议形式；
- (4)议事程序；
- (5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- (6)代理投票的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)、送达时间和地点；
- (7)表决方式；
- (8)会务常设联系人姓名、电话；

(9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(10)召集人需要通知的其他事项。

2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下,由召集人决定通讯方式和书面表决方式,并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,不影响计票和表决结果。

(五)基金份额持有人出席会议的方式

1.会议方式

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会、通讯方式开会及法律法规、中国证监会允许的其他方式。

(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席,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,如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。

(3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4)在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决,或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

(5)会议的召开方式由召集人确定。

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,现场会议方可举行:

1)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示,全部有效凭证所对应的

基金份额应占权益登记日基金总份额的 50% 以上(含 50%，下同)；

2)到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记结算资料相符。

(2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2)召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4)本人直接出具书面意见和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；

5)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提交的持有基金份额的凭证、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，并与登记结算机构记录相符。

(六)议事内容与程序

1.议事内容及提案权

(1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2)基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由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：

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进行解释和说明。

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)单独或合并持有权益登记日基金总份额 10% 以上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，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，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。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

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

(2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，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第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3. 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。

(七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1. 基金份额持有人所持每一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) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的 50% 以上通过方为有效，除下列(2)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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人(或其代理人)所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3. 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4. 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，否则表面符合法律法规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采取记名方式进行投票表决。

6. 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。

(八) 计票

1. 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选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，由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如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。

2. 通讯方式开会

在通讯方式开会的条件下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，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。

(九) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1. 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，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决议。

3. 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。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。

(十) 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，联接基金的持有人可以凭所持有的联接基金份额

行使与 ETF 相关的持有人权利，如 ETF 持有人大会召集权、直接参加 ETF 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。

(十一)法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、基金收益分配原则、执行方式

(一)收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2.本基金收益分配采用现金方式；
- 3.基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过业绩比较基准同期累计报酬率达到 1% 以上，可进行收益分配；基金收益分配数额的确定原则在招募说明书中列明；
- 4.在符合基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配最多 4 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率；基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 5.基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；
- 6.法律法规、监管机构、登记结算机构或上海证券交易所另有规定的从其规定。

(二)收益分配方案

基金收益分配方案中应载明收益分配基准日、收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

(三)收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟订，由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

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。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(四)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应由基金份额持有人自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

(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.基金财产划拨支付的银行费用；
- 4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5.基金份额持有人大会费用；
- 6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7.基金的证券交易或结算所产生的费用；
- 8.基金的开户费用、账户维护费用；
- 9.基金的黄金现货合约交易或结算产生的相关费用（包括但不限于交易手续费、延期费、结算、过户费、仓储费、运保费等相关费用及其他类似性质的费用）；
- 10.基金的黄金租借业务及质押业务相关费用；
- 11.基金收益分配中所发生的费用；
- 12.数据使用等费用；
- 13.为了基金利益与基金有关的诉讼、追索费用，基金管理人与基金托管人因自身原因而导致的除外；
- 14.基金依照有关法律法规应当缴纳或预提到的任何税收、征费及相关利息、费用和罚金；
- 15.基金上市费及年费；
- 16.按照国家有关规定、基金合同约定或行业惯例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。

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。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与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，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。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

2. 基金托管人的托管费

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 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与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，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。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四) 不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒体进行公告。

(六)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

(一)投资目标

紧密跟踪国内黄金现货价格的表现。

(二)投资范围

本基金的投资范围包括：上海黄金交易所挂盘交易的黄金现货合约等黄金品种、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品种。

本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产的 90%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

(三)投资理念

黄金兼具商品和投资属性，具有资产保值、抵御通胀、与证券市场相关性低等投资优势。本基金主要投资于上海黄金交易所场内黄金，力求获得我国黄金现货市场收益率，为投资人提供一类管理透明、成本较低、具有物权担保、有效跟踪国内黄金现货价格的投资工具。

(四)投资策略

本基金通过将大部分基金财产投资并持有上海黄金交易所挂盘交易的黄金现货合约等黄金品种，来实现跟踪国内黄金现货价格表现的目标。本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产的 90%。若因特殊情况(如上海黄金交易所市场流动性不足、黄金现货合约存量不足、法律法规禁止或限制等)导致无法获得足够数量的黄金现货合约时，基金管理人将采用合理方法进行替代投资，以达到跟踪国内黄金现货价格的目的。

为更好地实现投资目标，本基金可以适当参与流动性好、交易活跃的黄金现货延期交收合约和黄金远期。在风险可控的前提下，本基金本着审慎原则，主要以提高投资效率、降低交易成本、风险管理等为目的，而非用于投机。基金管理人将根据宏观经济、政策法规和我国黄金市场供需状况等因素，结合定性和定量方法，确定黄金现货延期交收合约和黄金远期的投资时机。基金管理人将结合本

基金的总体规模、黄金延期交收合约市场流动性以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与黄金延期交收合约交易的投资比例。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.25%，年跟踪误差不超过 3%。

基于流动性管理的需要，本基金可以投资于期限在一年期以下的国家债券、央行票据和政策性金融债等，债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

基金管理人将建立黄金现货合约交易的决策小组，授权特定的管理人员负责黄金现货合约的投资审批事项，同时针对黄金现货合约交易制定投资决策流程和风险控制等制度。

未来，随着投资工具的发展和丰富，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

(五)业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为国内黄金现货价格收益率。

目前国内黄金现货价格收益率以 Au99.99 合约价格为基础进行计算。如果上海黄金交易所 Au99.99 合约终止交易，或者上海黄金交易所推出其他代表性更强、更适合作为我国黄金现货的基准价格的计算依据时，基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，有权变更本基金的业绩比较基准的计算依据，不需另行召开持有人大会。

(六)风险收益特征

本基金属于黄金 ETF，其风险收益特征与国内黄金现货价格的风险收益特征相似，不同于股票基金、混合基金、债券基金和货币市场基金。

(七)投资限制

1.组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

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

本基金在开始进行黄金现货合约投资之前，应与基金托管人就相关开户、清算、估值、交收等事宜另行具体协商。

如果法律法规对本基金合同约定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。

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。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

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)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)向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- (6)买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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)办理黄金实物的出、入库业务；
- (9)依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (10)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。

(八) 基金的黄金租借和黄金质押

本基金可以进行黄金租借和黄金质押。

(九)基金管理人代表基金行使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权利，保护基金份额持有人的利益；

2.有利于基金财产的安全与增值；

3.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。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一)计算方法

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0.001元，小数点后第四位四舍五入。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。

2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。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。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。

(二)公告方式

1.本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值；

2.在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发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；

3.基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日（或自然日）基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日（或自然日）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媒体和网站上。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(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第十一条第(二)款第1项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.但如变更基金合同的事项属于本基金合同第十一条第(二)款第 2 项约定的情形,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告,并报中国证监会备案。

(二)本基金合同的终止

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后应当终止:

1.基金份额持有人大会决定终止的;

2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;

4.相关法律法规或中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算

1.基金财产清算组

(1)基金合同终止时,成立基金财产清算组,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(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。

2.基金财产清算程序

基金合同终止,应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括:

(1)基金合同终止后,发布基金财产清算公告;

(2)基金合同终止时,由基金财产清算组统一接管基金财产;

(3)对基金财产进行清理和确认;

(4)对基金财产进行估价和变现;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;

- (6)聘请律师事务所出具法律意见书;
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (9)公布基金财产清算结果;
- (10)对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产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。

4.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) - (3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6.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。

八、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，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，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，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。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。