

# 前海开源黄金交易型开放式证券投资基金

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2024年05月22日

送出日期：2024年06月26日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

### 一、产品概况

基金简称	前海开源黄金 ETF	基金代码	159812
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
基金合同生效日	2020年04月29日	基金类型	其他类型
上市交易所	深圳证券交易所	上市日期	2020年05月29日
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
交易币种	人民币		
基金经理	梁溥森	开始担任本基金基金经理的日期	2020年05月14日
		证券从业日期	2014年07月01日
	孔芳	开始担任本基金基金经理的日期	2021年06月03日
		证券从业日期	2010年07月01日
其他	扩位证券简称：黄金基金 ETF		

### 二、基金投资与净值表现

#### (一) 投资目标与投资策略

详见《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金招募说明书》第十一章“基金的投资”。

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。
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 AU99.99、AU99.95。本基金主要投资的黄金现货延期交收合约 AU（T+D）。
主要投资策略	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。

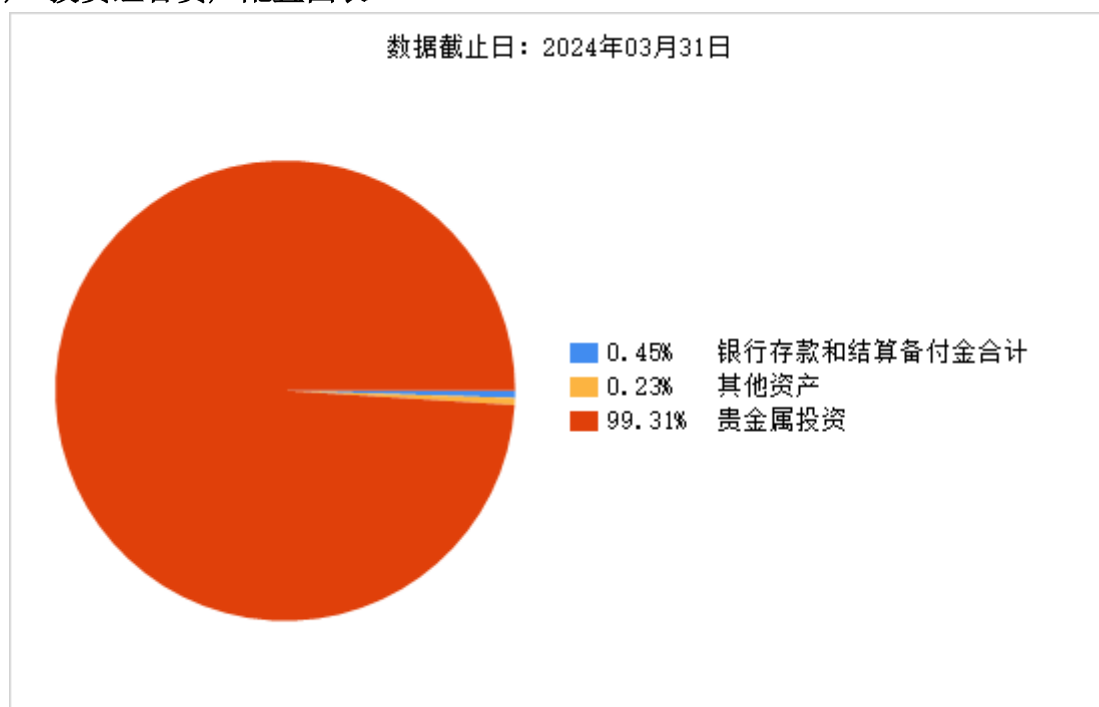
为降低基金费用对跟踪偏离度与跟踪误差的影响，本基金可以将持有的黄金现货合约借出给信誉良好的机构，取得租赁收入，并要求对方按时或提前归还黄金现货合约。本基金将谨慎考察黄金现货合约借入方的资信情况，根据基金的申购赎回情况、黄金的市场供求情况，决定黄金现货合约租赁的期限、借出的黄金现货合约占基金资产净值的比例及租赁利率等。

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 risk 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。

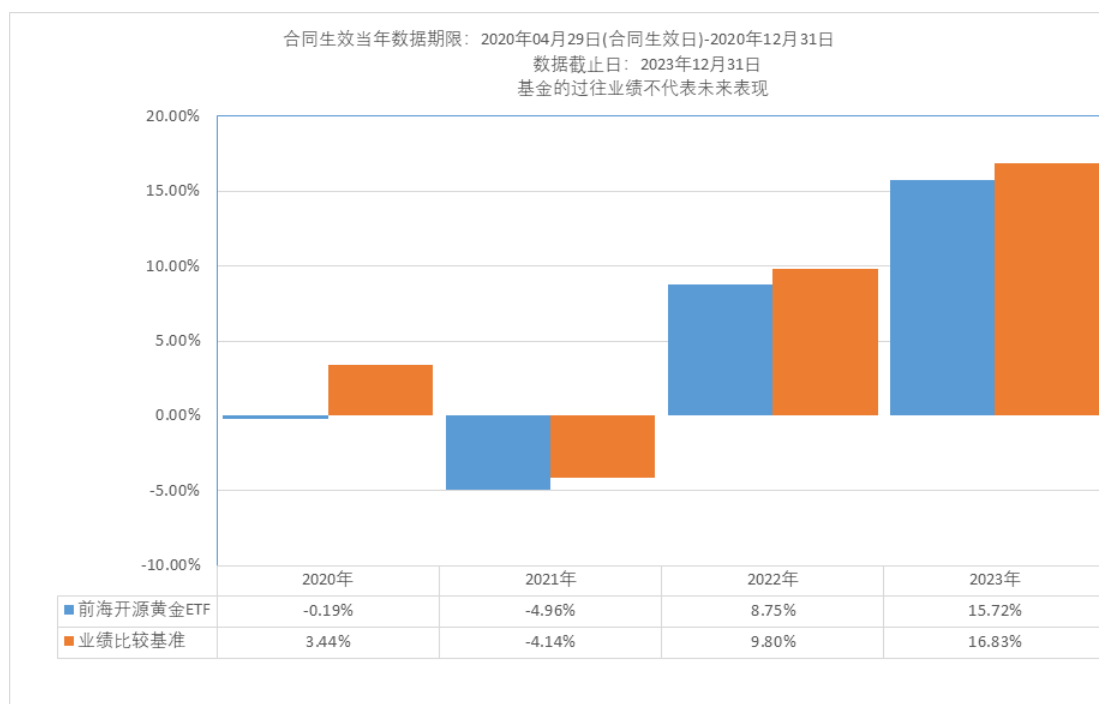
<b>业绩比较基准</b>	上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率。
<b>风险收益特征</b>	本基金主要投资对象为黄金现货合约，预期风险/收益水平与黄金相似，在证券投资基金中属于较高风险和预期收益的基金品种。

注：不同的销售机构采用的评价方法不同，本法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能存在不一致的风险，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

## （二）投资组合资产配置图表



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



注：本基金的基金合同于2020年04月29日生效，2020年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

### 三、 投资本基金涉及的费用

#### （一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

- 1、本基金场内份额申购、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；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；
- 2、场内交易费用以证券公司实际收取为准。

#### （二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	0.50%	基金管理人和销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	5.00 万元	会计师事务所
信息披露费	12.00 万元	规定披露报刊
其他费用	本基金其他费用详见基金合同或招募说明书费用章节，按实际发生金额从基金资产扣除。	-

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。  
2、审计费用、信息披露费年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

#### （三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
0.80%

注：基金运作综合费率=固定管理费率+托管费率+销售服务费率（若有）+其他运作费用合计占基金每日平均资产净值的比例（年化），其中，基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

## 四、 风险揭示与重要提示

### （一） 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、 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。

##### （2） 基金跟踪偏离风险

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

##### （3） 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，可能造成本基金折溢价率高于股票类 ETF。

##### （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一定调整，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

#### (12) 投资者赎回失败的风险

#### (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。

#### (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。

2、流动性风险。3、其他风险。主要包括：1) 第三方机构服务的风险；2) 管理风险与操作风险；3) 技术风险；4) 不可抗力。

## (二) 重要提示

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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

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。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[www.qhkyfund.com][客服电话：4001-666-998]

- 《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金基金合同》、《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金托管协议》、《前海开源黄金交易型开放式证券投资基金招募说明书》
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料

## 六、 其他情况说明

无。