

博时黄金交易型开放式证券投资基金(博时黄金ETF场外D类)基金 产品资料概要更新

编制日期：2023年8月24日

送出日期：2023年8月25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	博时黄金 ETF	基金代码	159937
下属基金简称	博时黄金 ETF 场外 D 类	下属基金代码	000929
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2014-08-13	上市交易所及上市日期	该类份额不上市
基金类型	其他类型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日开放申购、赎回
基金经理	王祥	开始担任本基金基金经理的日期	2016-11-02
		证券从业日期	2012-07-01
	赵云阳	开始担任本基金基金经理的日期	2015-10-08
		证券从业日期	2010-08-31
扩位简称	黄金 ETF 基金		

注：本基金 D 类基金份额于 2014 年 12 月 18 日新增。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

敬请投资者阅读更新的《招募说明书》第十一章了解详细情况

投资目标	本基金通过投资于黄金交易所的黄金现货合约，在跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下，争取为投资者提供与标的指数表现接近的投资回报。
投资范围	本基金可以投资黄金交易所的黄金现货合约及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于黄金交易所的黄金现货合约，包括：黄金现货实盘合约、黄金现货延期交收合约及其他在上海黄金交易所上市的、经中国人民银行批准的合约。本基金主要投资的黄金现货实盘合约约为AU99.99、AU99.95。本基金主要投资的黄金现货延期交收合约约为AU(T+D)。本基金主要投资的黄金现货合约可以根据市场流动性情况的变化进行调整。本基金可从事黄金现货租赁业务。 建仓完成后，本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产的90%，其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 基于跟踪误差、流动性因素和交易便利程度的考虑，黄金现货实盘合约中，本基金将主要投资于AU99.99。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法买入足够的

AU99.99时，基金管理人可投资于AU99.95和AU（T+D）或其他品种以进行适当替代。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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。

主要投资策略

本基金主要采取被动式管理策略。本基金投资于黄金现货合约的资产比例不低于基金资产的90%。基于跟踪误差、流动性因素和交易便利程度的考虑，黄金现货实盘合约中，本基金将主要投资于AU99.99。但因特殊情况（包括但不限于流动性不足等）导致本基金无法买入足够的AU99.99时，基金管理人可投资于AU99.95和AU（T+D）或其他品种以进行适当替代。在正常市场情况下，本基金的风险管理目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。当基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围时，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为黄金现货实盘合约AU99.99收益率。

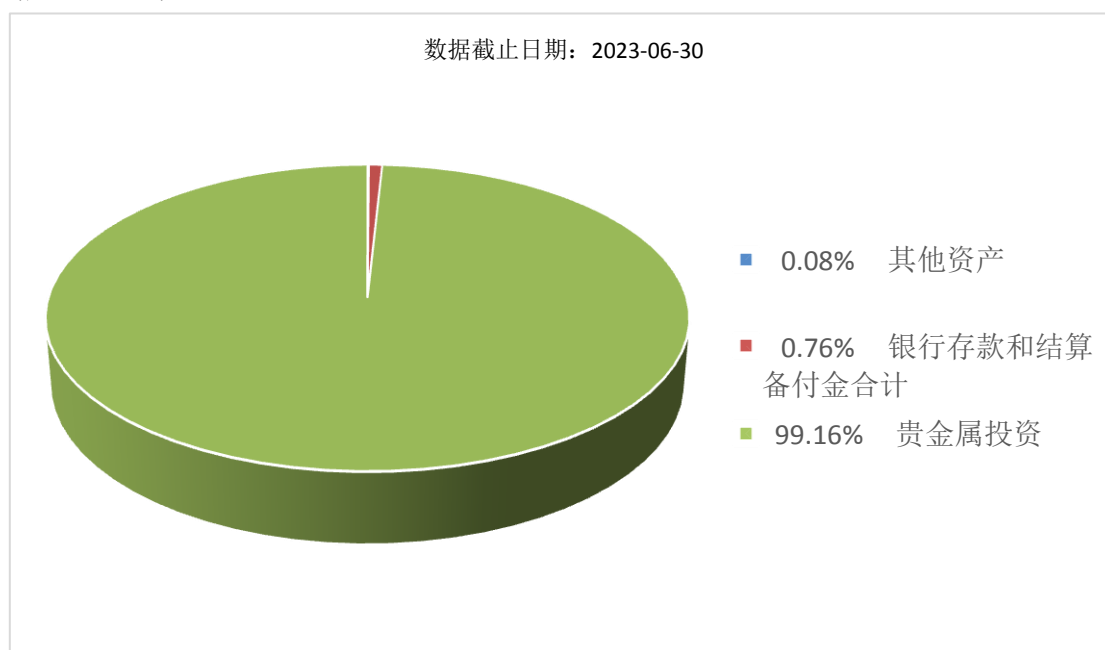
基金管理人有权变更本基金的业绩比较基准，而无须召开基金份额持有人大会。

风险收益特征

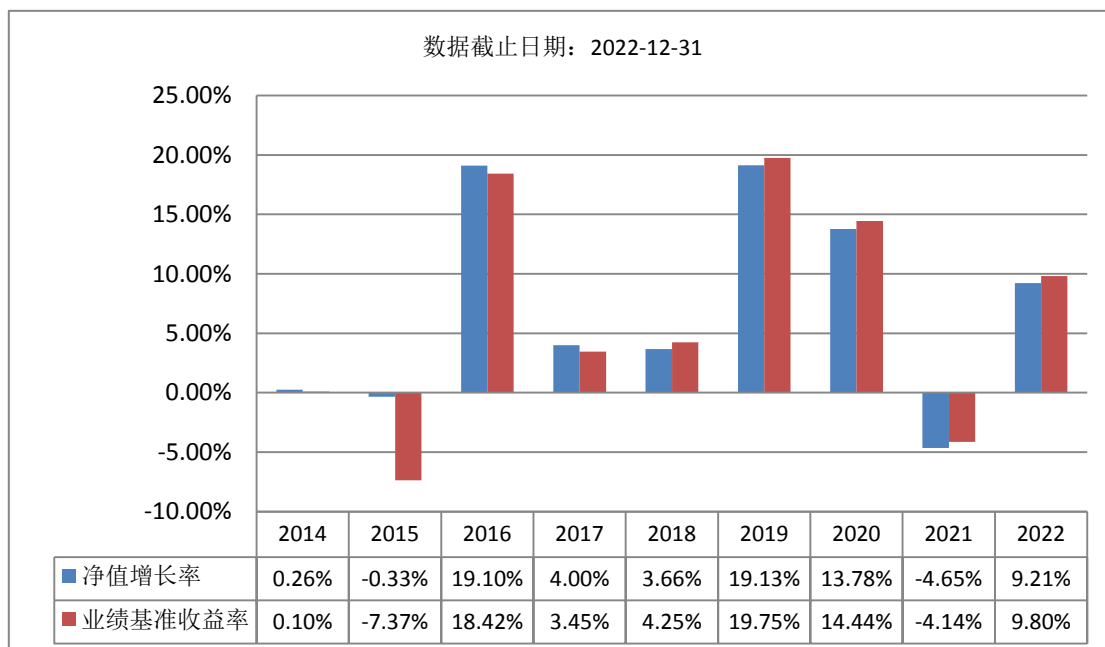
本基金主要投资对象为黄金现货合约，预期风险/收益水平与黄金相似，在证券投资基金中属于较高风险和预期收益的基金品种。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

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：基金的过往业绩不代表未来表现。本基金份额生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

场内交易费用以证券公司实际收费为准。

申购费：

申购费率为 0.05%

赎回费：

赎回费率为 0.05%

(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
管理费	固定比例 0.50%
托管费	固定比例 0.10%
其他费用	基金的上市费及年费；基金收益分配发生的费用；因基金的证券交易或结算而产生的费用；基金合同生效以后的信息披露费用，法律法规、中国证监会另有规定的除外；基金份额持有人大会费用；基金合同生效以后的会计师费和律师费；基金资产的资金汇划费用；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；按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

注：本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资者应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，及时关注本公司出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，本公司的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，

结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

1、本基金特有风险：

(1) 基金跟踪偏离的风险：由于各种因素的影响，本基金的业绩表现与业绩比较基准之间可能产生差异，即跟踪偏离风险。

(2) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险：本基金为交易所交易基金，存在二级市场交易价格与一级市场申购赎回价格之间偏离的可能性。

(3) 基金份额交易价格折溢价相对股票类 ETF 可能较高的风险：有效的套利交易会使得 ETF 交易价格和份额净值之间的偏离较快趋于一致，但由于本基金的二级市场交易场所为深圳证券交易所，而本基金主要投资标的的交易场所为上海黄金交易所，两个交易所涨跌停板制度的差异、交易时间的差异以及节假日的差异等原因可能造成本基金折溢价率高于股票类 ETF。

(4) 本基金交易时间与境内外黄金市场交易时间不一致的风险：由于本基金申购、赎回的开放时间以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。

(5) 业绩比较基准变更的风险：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。

(6) 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。

(7) 参考基金份额参考净值 (IOPV) 决策的风险：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，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) 投资者认购或申购失败的风险：1) 如投资者提交本基金场内份额的现券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，或未能根据现券申购赎回清单的要求备足预估现金差额，则场内份额的现券申购申请失败。2) 如投资者提交本基金场内份额的现金申购申请时，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，则场内份额的现金申购申请失败。3) 本基金还可能在现券申购赎回清单和现金申购赎回清单中分别设定申购份额上限。对于以现券申购方式提交的申购申请，如果一笔新的被确认成功的申购申请，会使本基金的当日申购份额超过现券申购赎回清单中设定的当日申购份额上限时，该笔申购申请将被拒绝；对于以现金申购方式提交的申购申请，如果一笔新的被确认成功的申购申请，会使本基金的当日申购份额超过现金申购赎回清单中设定的当日申购份额上限时，该笔申购申请将被拒绝。4) 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。

(9) 投资者赎回失败的风险：1) 如投资者提交本基金场内份额的现券赎回申请时未完成账户备案，则现券赎回申请失败。2) 如投资者提交本基金场内份额的现券赎回申请时所持有的符合要求的基金份额不足，或未能根据现券申购赎回清单的要求备足预估现金差额，则场内份额的现券赎回申请失败。3) 如投资者提交本基金场内份额的现金赎回申请时所持有的符合要求的基金份额不足，或未能根据现金申购赎回清单的要求备足预估现金差额，则场内份额的现金赎回申请失败。4) 本基金还可能在现券申购赎回清单和现金申购赎回清单中分别设定赎回份额上限。对于以现券赎回方式提交的份额赎回申请，如果一笔新的被确认成功赎回申请，会使本基金当日赎回份额超过现券申购赎回清单中设定的当日赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝；对于以现金赎回方式提交的份额赎回申请，如果一笔新的被确认成功的份额赎回申请，会使本基金当日赎回份额超过现金申购赎回清单中设定的当日赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝。5) 随着市场环境的变动，基金管理人有可能调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。6) 在当前的交易规则下，投资者 T 日买入的基金份额 T+1 日可赎回。但是，如果对应的结算参与人当日日终资金不足，则 T+1 日可能出现投资者赎回黄金现货实盘合约失败的情形。

(10) 不同申购赎回模式下交易和结算规则存在差异的风险：本基金的申赎分为场内份额的现券申赎、场内份

额的现金申赎、场外份额的现金申赎。不同的申赎方式下，本基金的申购赎回办理时间及办理条件、登记结算规则等或有差异。

(11) 基金份额交易规则调整的相关风险：因深圳证券交易所、登记结算机构及上海黄金交易所等服务机构可能就本基金基金份额的交易、结算等相关规则进行调整，本基金基金份额申购、赎回的登记交收规则或上市交易的交易规则可能因此而发生变化。基金管理人届时将根据相关服务机构的调整后的业务规则及本基金的运作需要，适时调整本基金各申赎模式的交易、结算规则。本基金基金份额交易、结算规则的调整或将涉及相关业务办理时间及销售机构的调整，可能与投资者的交易习惯有一定差异。

(12) 本基金场外份额暂不可上市交易的风险：本基金场内份额的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外份额的登记结算机构为基金管理人。在场外份额、场内份额之间开通跨系统转托管业务前，场外份额暂不可转托管至场内，也不可上市交易。

(13) 参与黄金租赁业务的风险：本基金可以参与黄金现货租赁业务。是指本基金用所持有的黄金交易所的现货黄金合约向合作机构租赁出黄金，并按照合同约定收取租赁费用，合作租入方到期归还等额同质黄金的业务。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。

2、本基金普通风险：市场风险（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，跟踪黄金现货合约价格，黄金价格波动为产品的主要风险）、流动性风险、操作风险、技术风险、管理风险、不可抗力风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

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

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.bosera.com][客服电话：95105568]

- (1)基金合同、托管协议、招募说明书
- (2)定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (3)基金份额净值
- (4)基金销售机构及联系方式
- (5)其他重要资料

六、其他情况说明

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