

# 博时黄金交易型开放式证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

### 2015 年第 1 号

#### 【重要提示】

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

2、本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

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

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

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

4、投资本基金可能遇到的风险包括黄金市场波动风险、基金跟踪偏离风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、本基金交易时间与境内外黄金市场交易时间不一致的风险、不同申购赎回模式下交易和结算规则存在差异的风险、基金份额交易规则调整的相关风险等特有风险，以及第三方机构服务的风险、管理风险、操作风险、交收失败风险、技术风险、不可抗力风险等。

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

5、本基金向投资者开放场内份额的现券申购、赎回业务，场内份额的现金申购、赎回

业务，场外份额的现金申购、赎回业务。不同申购、赎回方式的开放日与开放时间、清算交收及登记结算规则或有差异。

在本基金开放申购、赎回后：

(1) 投资者参与黄金现货实盘合约申购，需要持有深圳 A 股账户或证券投资基金账户，以及上海黄金交易所黄金账户（以下简称“黄金账户”）。投资者在首次参与黄金现货实盘合约申购前须根据上海黄金交易所的相关规定，完成账户备案。

(2) 仅持有深圳 A 股账户的投资者，除可参与本基金基金份额二级市场交易，还可参与本基金场内份额的现金申购、赎回；

(3) 仅持有深圳证券交易所基金账户的投资者，仅可参与本基金基金份额的二级市场交易，不能参与本基金的申购、赎回；

(4) 投资者进行黄金现货实盘合约申购或赎回时，单一账户每笔申购或赎回份额须为最小申赎单位的整数倍，最高不得超过 999,999,999 份，申购、赎回份额上限的具体规定详见每日公布的申购赎回清单。

敬请投资者详细阅读《基金合同》、《招募说明书》关于本基金各类申购、赎回方式的说明。

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

7、在目前结算规则下，投资者交易、申购、赎回本基金，应当遵守下列规定，具体以深圳证券交易所、登记结算机构及上海黄金交易所等服务机构的规则为准：

(1) 投资者 T 日买入的场内份额，T 日可以卖出；

(2) 投资者 T 日买入的场内份额，T+1 日可以赎回。如果对应的结算参与人当日日终资金不足，T+1 日不得以黄金现货实盘合约作为对价进行赎回；

(3) 投资者 T 日以现券申购方式申购的场内份额，T 日可以卖出或赎回；投资者 T 日以现券赎回方式赎回场内份额后，T 日可卖出赎回获得的黄金现货实盘合约；投资者 T 日以现金申购方式申购的场内份额，T+1 日可卖出或赎回。

(4) 以现金赎回方式赎回场内份额的，登记结算机构对现金替代采取逐笔全额非担保交收模式。当登记结算机构确认投资者的赎回申请后，基金份额即被记减，但此时投资者尚未收到赎回款。

(5) 未来，如深圳证券交易所、登记结算机构及上海黄金交易所等服务机构就本基金基金份额的交易、结算等相关规则进行调整，基金管理人或将调整本基金相关业务的具体办理时间及销售机构，请投资者关注基金管理人及相关服务机构的相关公告。

8、本基金基金份额根据登记结算机构的不同分为场内份额与场外份额。本基金的场外份额根据费用收取方式的不同分为 D 类场外份额和 I 类场外份额。

本基金场内份额、D 类场外份额和 I 类场外份额单独设置基金代码，并分别公布基金份

额净值。

9、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。

10、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》及《基金合同》。11、基金的过往业绩并不预示其未来表现。

12、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。

基金招募说明书自基金合同生效日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告，更新内容截至每 6 个月的最后 1 日。

本招募说明书更新所载内容截止日为 2015 年 2 月 13 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2014 年 12 月 31 日。（财务数据未经审计）

## 第一部分 基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称： 博时基金管理有限公司

住所： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址： 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

法定代表人： 洪小源

成立时间： 1998 年 7 月 13 日

注册资本： 2.5 亿元人民币

存续期间： 持续经营

联系人： 沈康

联系电话： (0755) 8316 9999

博时基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基字[1998]26 号文批准设立。目前公司股东为招商证券股份有限公司，持有股份 49%；中国长城资产管理公司，持有股份 25%；天津港（集团）有限公司，持有股份 6%；璟安股权投资有限公司，持有股份 12%；上海盛业股权投资基金有限公司，持有股份 6%；广厦建设集团有限责任公司，持有股份 2%。注册资本为 2.5 亿元人民币。

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

公司下设三大总部和十三个直属部门，分别是：权益投资总部、固定收益总部、市场销售总部以及宏观策略部、交易部、指数投资部、产品规划部、互联网金融部、董事长办公室、总裁办公室、人力资源部、财务部、信息技术部、基金运作部、风险管理部和监察法律部。

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

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

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

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

截止到 2014 年 9 月 30 日，公司总人数为 389 人，其中研究员和基金经理超过 94%拥有硕士及以上学位。

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

## （二）主要成员情况

### 1、基金管理人董事会成员

洪小源先生，双硕士，董事长。1988 年以来曾就职于国家经济体制改革委员会综合规划司，后历任深圳龙蕃实业股份有限公司总经理、招商局蛇口工业区有限公司总经理助理、招商局地产控股股份有限公司总经理，招商局科技集团有限公司总经理、招商局蛇口工业区有限公司副总经理；曾任中诚信托有限责任公司董事、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董

事、招商昆仑股权投资管理有限公司董事长、招商海达保险顾问有限公司董事长、招商局保险有限公司董事长、招商局中国投资管理有限公司董事长。现任招商局集团有限公司总经理助理、招商局金融集团有限公司总经理、招商局中国基金有限公司董事长；招商证券股份有限公司董事兼风险管理委员会主任、招商银行股份有限公司董事兼风险及资本管理委员会主任。2014 年 11 月起，任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。2015 年 1 月起，兼任博时基金（国际）有限公司董事、董事会主席。

桑自国先生，博士后，副董事长。1993 年起历任山东证券投资银行部副总经理、副总经理、泰安营业部副总经理，中经信投资公司总经理助理、中经证券有限公司筹备组组长，永汇信用担保有限公司董事长、总经理，中国华融资产管理公司投资事业部总经理助理、副总经理，中国长城资产管理公司投资投行事业部副总经理、总经理。2011 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第五届董事会董事。2013 年 8 月起，任博时基金管理有限公司第五届董事会副董事长。2014 年 11 月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会副董事长。

熊剑涛先生，硕士，工程师，董事。1992 年 5 月至 1993 年 4 月任职于深圳山星电子有限公司。1993 年起，历任招商银行总行电脑部信息中心副经理，招商证券股份有限公司电脑部副经理、经理、电脑中心总经理、技术总监兼信息技术中心总经理；2004 年 1 月至 2004 年 10 月，被中国证监会借调至南方证券行政接管组任接管组成员；2005 年 12 月起任招商证券股份有限公司副总裁，现分管经纪业务、资产管理业务、信息技术中心，兼任招商期货有限公司董事长、中国证券业协会证券经纪专业委员会副主任委员。2014 年 11 月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会董事。

吴姚东先生，博士，北京大学光华管理学院 EMBA，董事。2002 年进入招商证券股份有限公司，历任国际业务部分析师、招商证券武汉营业部总经理、招商证券（香港）公司总经理兼国际业务部董事、总裁办公室总经理、董事总经理、公司总裁助理。2013 年 5 月加入博时基金管理有限公司，现任公司总经理、董事，博时基金（国际）有限公司董事会副主席兼总裁、博时资本管理有限公司董事长兼总经理。2013 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会董事。

王金宝先生，硕士，董事。1988 年 7 月至 1995 年 4 月在上海同济大学数学系工作，任教师。1995 年 4 月进入招商证券，先后任上海澳门路营业部总经理、上海地区总部副总经理（主持工作）、投资部总经理、投资部总经理兼固定收益部总经理、股票销售交易部总经理（现更名为机构业务总部）、机构业务董事总经理。2002 年 10 月至 2008 年 7 月，任博时基金管理有限公司第二届、第三届监事会监事。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四届至第六届董事会董事。

杨林峰先生，硕士，高级经济师，董事。1988 年 8 月就职于国家纺织工业部，1992 年 7 月至 2006 年 6 月任职于中国华源集团有限公司，先后任华源发展股份有限公司（上海证交所上市公司）董秘、副总经理、常务副总经理等职。2006 年 7 月就职于上海市国资委直

属上海大盛资产有限公司，任战略投资部副总经理。2007 年 10 月至今，出任上海盛业股权投资基金有限公司执行董事、总经理。2011 年 7 月至 2013 年 8 月，任博时基金管理有限公司第五届监事会监事。2013 年 8 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会董事。

何迪先生，硕士，独立董事。1971 年起，先后在北京西城区半导体器件厂、北京东城区电子仪器一厂、中共北京市委党校、社科院美国研究所、加州大学伯克利分校、布鲁津斯学会、标准国际投资管理公司工作。1997 年 9 月至今任瑞银投资银行副主席。2008 年 1 月，何迪先生建立了资助、支持中国经济、社会与国际关系领域中长期问题研究的非营利公益组织“博源基金会”，并担任该基金会总干事。2012 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

李南峰先生，学士，独立董事。1969 年起先后在中国人民解放军酒泉卫星基地、四川大学经济系、中国人民银行、深圳国际信托投资公司、华润深国投信托有限公司工作，历任中国人民银行总行金融研究所研究院、深圳特区人行办公室主任，深圳国际信托投资公司副总经理、总经理、董事长、党委书记，华润深国投信托有限公司总经理、副董事长。1994 年至 2008 年曾兼任国信证券股份有限公司董事、董事长。2010 年退休。2013 年 8 月起，任博时基金管理有限公司第五届、第六届董事会独立董事。

顾立基先生，硕士，独立董事。1968 年至 1978 年就职于上海印染机械修配厂，任共青团总支书记；1983 年起，先后任招商局蛇口工业区管理委员会办公室秘书、主任；招商局蛇口工业区免税品有限公司董事总经理；中国国际海运集装箱股份有限公司董事副总经理、总经理；招商局蛇口工业区有限公司副总经理、国际招商局贸易投资有限公司董事副总经理；蛇口招商港务股份有限公司董事总经理；招商局蛇口工业区有限公司董事总经理；香港海通有限公司董事总经理；招商局科技集团有限公司董事总经理、招商局蛇口工业区有限公司副总经理。2008 年退休。2008 年 2 月至今，任清华大学深圳研究生院兼职教授；2008 年 11 月至 2010 年 10 月，兼任招商局科技集团有限公司执行董事；2009 年 6 月至今，兼任中国平安保险（集团）股份有限公司外部监事、监事会主席；2011 年 3 月至今，兼任湘电集团有限公司外部董事；2013 年 5 月至 2014 年 8 月，兼任德华安顾人寿保险有限公司（ECNL）董事；2013 年 6 月至今，兼任深圳市昌红科技股份有限公司独立董事；2014 年 12 月至今，兼任深圳市创鑫激光股份有限公司董事。2014 年 11 月起，任博时基金管理有限公司第六届董事会独立董事。

## 2、基金管理人监事会成员

车晓昕女士，硕士，监事。1983 年起历任郑州航空工业管理学院助教、讲师、珠海证券有限公司经理、招商证券股份有限公司投资银行总部总经理。现任招商证券股份有限公司财务管理董事总经理。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

彭毛宇先生，学士，监事。1982 年 8 月起历任中国农业银行总行农贷部国营农业信贷处科员、副处长，中国农业发展银行开发信贷部扶贫信贷处处长，中国农业银行信贷管理三

部扶贫贷款管理处处长，中国农业银行总行项目评估部副总经理、金桥金融咨询公司副总经理。1999 年 12 月至 2011 年 1 月在中国长城资产管理公司工作，先后任评估咨询部副总经理，债权管理部（法律事务部）副总经理，南宁办事处副总经理（党委委员），监察审计部（纪委办公室）总经理。2007 年 12 月至今兼任新疆长城金融租赁有限公司监事会主席。2011 年 1 月至今任中国长城资产管理公司控股子公司专职监事（总经理级）。2011 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第五至六届监事会监事。

赵兴利先生，硕士，监事。1987 年至 1995 年就职于天津港务局计财处。1995 年至 2012 年 5 月先后任天津港贸易公司财务科科长、天津港货运公司会计主管、华夏人寿保险股份有限公司财务部总经理、天津港财务有限公司常务副总经理。2012 年 5 月筹备天津港（集团）有限公司金融事业部，2011 年 11 月至今任天津港（集团）有限公司金融事业部副部长。2013 年 3 月起，任博时基金管理有限公司第五至六届监事会监事。

郑波先生，博士，监事。2001 年起先后在中国平安保险公司总公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司人力资源部总经理。2008 年 7 月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

林琦先生，硕士，监事。1998 年起历任南天信息系统集成公司任软件工程师、北京万豪霸电子科技有限公司任技术经理、博时基金管理有限公司 MIS 系统分析员、东方基金管理有限公司总经理助理、博时基金管理有限公司信息技术部副总经理。现任博时基金管理有限公司信息技术部总经理。2010 年 4 月起，任博时基金管理有限公司第四至六届监事会监事。

赵卫平先生，硕士，监事。1996 年起先后在山东国际信托投资公司、大鹏证券公司、北京证券公司、博时基金管理有限公司工作。现任博时基金管理有限公司交易部总经理。2013 年 8 月起，任博时基金管理有限公司第五至六届监事会监事。

### 3、高级管理人员

洪小源先生，简历同上。

吴姚东先生，简历同上。

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

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

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

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

#### 4、本基金基金经理

方维玲女士，硕士。1982 年起曾先后在云南大学、海南省信托投资公司、湘财证券、北京玖方量子子公司工作。2001 年 3 月加入博时基金管理有限公司，历任金融工程小组金融工程师、量化投资部金融工程师兼行政助理、量化投资部副总经理兼金融工程师、产品规划部总经理、股票投资部投资经理、基金经理助理。现任上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（2012.11.13-至今）、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理（2012.11.13-至今）、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（2013.9.13-至今）、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理（2013.9.13-至今）、博时黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理（2014 年 08 月 13 日至今）。

#### 5、投资决策委员会成员

委员：吴姚东、董良泓、邵凯、万定山、黄健斌、魏凤春、李权胜。

吴姚东先生，简历同上。

董良泓先生，简历同上。

邵凯先生，简历同上。

万定山先生，硕士。1999 至 2000 年曾在海尔集团工作。2004 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、研究员兼基金经理助理、年金账户基金经理、特定资产管理部副总经理。现任权益投资总部董事总经理兼特定资产管理部总经理、社保组合投资经理。

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

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

李权胜先生，硕士。2001 年起先后在招商证券、银华基金工作。2006 年加入博时基金管理有限公司，历任研究员、研究员兼基金经理助理、特定资产投资经理、特定资产管理部副总经理、博时医疗保健行业股票基金基金经理、股票投资部副总经理。现任股票投资部总经理兼成长组投资总监、博时精选股票基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 第二部分 基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管业务部总经理：李爱华

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：（010）66594942

### （二）基金托管部门及主要人员情况

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

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

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2014 年 12 月 31 日，中国银行已托管 307 只证券投资基金，其中境内基金 282 只，QDII 基金 25 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、场外份额销售机构

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址：北京市建国门内大街 18 号恒基中心 1 座 23 层

电话：010-65187055

传真：010-65187032

联系人：尚继源

全国统一客服热线：95105568（免长途费）

#### 2、场内份额现金申购、赎回办理机构（以下排序不分先后）

招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、光大证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、万联证券有限责任公司。

#### 3、场内份额实物申购、赎回办理机构

##### (1) 中国工商银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：王均山

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

网址：<http://www.icbc.com.cn/>

##### (2) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

联系人：温从镭

传真：021-58408928

客户服务电话：95559

网址：<http://www.bankcomm.com/>

基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减发售本基金的代理机构，并及时公告。

## 二、登记结算机构

### 1、场内份额登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

电话：0755-25946013

传真：0755-25987122

联系人：严峰

### 2、场外份额登记结算机构

名称：博时基金管理有限公司

住所：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 29 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 A 座 5 层

法定代表人：洪小源

电话：010-65171166

传真：010-65187068

联系人：许鹏

## 三、上海黄金交易所

名称：上海黄金交易所

注册地址：上海市黄浦区河南中路 99 号上海黄金交易所大厦

办公地址：上海市黄浦区河南中路 99 号上海黄金交易所大厦

电话：021-33189588

传真：021-33662058

联系人：杨艳

## 四、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：吕红、安冬

## 五、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法人代表： 杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

## 第四部分 基金的名称

博时黄金交易型开放式证券投资基金

## 第五部分 基金的类型

交易型开放式

## 第六部分 基金的投资目标

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。

## 第七部分 投资的方向

本基金可以投资黄金交易所的黄金现货合约及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于黄金交易所的黄金现货合约，包括：黄金现货实盘合约、黄金现货延期交收合约及其他在上海黄金交易所上市的、经中国人民银行批准的合约。本基金主要投资的黄金现货实盘合约为 AU99.99、AU99.95。本基金主要投资的黄金现货延期交收合约为 AU（T+D）。本基金主要投资的黄金现货合约可以根据市场流动性情况的变化进行调整。本基金可从事黄金现货租赁业务。

建仓完成后，本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产的 90%，其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

本基金主要投资的黄金现货合约可以根据市场流动性情况的变化进行调整，此调整无须召开持有人大会。本基金可从事黄金现货租赁业务。

## 第八部分 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。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

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。

## 第十部分、基金的风险收益特征

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。

## 第十一部分、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本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 2014 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 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	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	23,563,780.00	97.15
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	685,194.89	2.83

7	其他各项资产	4,937.54	0.02
8	合计	24,253,912.43	100.00

## 2. 报告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。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	AU9999	Au99.99	72,000.00	17,322,480.00	75.50
2	AU9995	Au99.95	26,000.00	6,241,300.00	27.20

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11. 投资组合报告附注

11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

## 11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	4,937.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,937.54

#### 11.4 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债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十二部分 基金的业绩

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。

自基金合同生效开始基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

### 1、博时黄金 ETF：

期间	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
2014.8.13-2014.12.31	-5.30%	0.98%	-7.47%	1.04%	2.17%	-0.06%

### 2、博时黄金 ETF 场外 D 类：

期间	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
2014.12.18-2014.12.31	0.26%	0.67%	0.10%	0.86%	0.16%	-0.19%

### 3、博时黄金 ETF 场外 I 类：

期间	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

2014. 12. 18-2014. 12. 31	0. 21%	0. 67%	0. 10%	0. 86%	0. 11%	-0. 19%
---------------------------	--------	--------	--------	--------	--------	---------

注：本基金的业绩比较基准为黄金现货实盘合约 AU99.99 收益率。自 2014 年 12 月 18 日起对本基金增设 I 类场外份额，同时，本基金原场外份额变更为本基金的 D 类场外份额。本基金的场外份额根据费用收取方式的不同分为 D 类场外份额和 I 类场外份额。D 类场外份额和 I 类场外份额单独设置基金代码，并分别公布基金份额净值。

## 第十三部分 基金费用概览

### 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、场外份额的销售服务费；
- 4、基金的上市费及年费；
- 5、基金收益分配发生的费用；
- 6、因基金的证券交易或结算而产生的费用；
- 7、基金合同生效以后的信息披露费用；
- 8、基金份额持有人大会费用；
- 9、基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- 10、基金资产的资金汇划费用；
- 11、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；
- 12、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；
- 13、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.5% 年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

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

#### 2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.1% 年费率计提。

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 3、场外份额的销售服务费

本基金场外份额暂不收取销售服务费。本基金场外份额的销售服务费可以根据基金合同的相关规定进行调整并在调整前进行公告。

4、本条第一款第 4 至第 13 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### 三、不列入基金费用的项目

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

### 四、基金管理费和基金托管费的调整

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

### 五、其他费用

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

## 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2014 年 8 月 1 日刊登的本基金原招募说明书（《博时黄金交易型开放式证券投资基金招募说明书》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

- 1、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的基本情况进行了更新；
- 2、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况进行了更新；
- 3、在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构的内容；
- 4、在“十、基金份额的申购与赎回”中，增加了场外份额申购与赎回相关说明；
- 5、在“十一、基金的投资”中，更新了基金投资组合报告的内容，数据内容截止时间为 2014 年 12 月 31 日；
- 6、在“十二、基金的业绩”中，更新了“自基金合同生效开始基金份额净值增长率”

的数据及列表内容，数据内容截止时间为 2014 年 12 月 31 日；

7、在“二十四、其它应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新：

(一)2015 年 1 月 31 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时基金管理有限公司关于博时黄金交易型开放式证券投资基金 I 类场外份额直销网上交易小额赎回业务的公告](#)》；

(二)2015 年 1 月 21 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时黄金交易型开放式证券投资基金 2014 年第 4 季度报告](#)》；

(三) 2014 年 12 月 18 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时基金关于开通博时黄金交易型开放式证券投资基金 I 类场外份额直销网上交易业务的公告](#)》；

(四) 2014 年 12 月 15 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[关于修订博时黄金交易型开放式证券投资基金基金合同及托管协议部分条款的公告](#)》和《[博时基金管理有限公司关于博时黄金交易型开放式证券投资基金增设 I 类场外份额及原场外份额变更的公告](#)》；

(五) 2014 年 10 月 31 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时基金管理有限公司关于增加博时黄金交易型开放式证券投资基金现金申购赎回办理机构的公告](#)》；

(六) 2014 年 9 月 1 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时基金管理有限公司关于增加博时黄金交易型开放式证券投资基金现金申购赎回办理机构的公告](#)》和《[博时黄金交易型开放式证券投资基金上市交易提示性公告](#)》；

(七) 2014 年 8 月 29 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时基金管理有限公司关于博时黄金交易型开放式证券投资基金基金份额折算结果公告](#)》；

(八) 2014 年 8 月 28 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时基金管理有限公司关于增加博时黄金交易型开放式证券投资基金现券申购赎回办理机构的公告](#)》和《[关于博时黄金交易型开放式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告的补充公告](#)》；

(九) 2014 年 8 月 27 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时黄金交易型开放式证券投资基金上市交易公告书](#)》和《[博时黄金交易型开放式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告](#)》；

(十) 2014 年 8 月 26 日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时基金管理有限公司关于博时黄金交易型开放式证券投资基金基金份额折算的公告](#)》；

(十一) 2014 年 8 月 14 日, 我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《[博时黄金交易型开放式证券投资基金基金合同生效公告](#)》。

博时基金管理有限公司  
2015 年 3 月 30 日