博时黄金交易型开放式证券投资基金

2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

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

报告送出日期：二〇一六年八月二十五日

cninf 巨潮资讯
www.cninfo.com.cn
中国证监会指定信息披露网站

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	博时黄金 ETF		
场内简称	博时黄金		
基金主代码	159937		
交易代码	159937		
基金运作方式	交易型开放式指数基金		
基金合同生效日	2014 年 8 月 13 日		
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		
报告期末基金份额总额	792,699,376.39 份		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2014 年 9 月 1 日		
下属分级基金的基金简称	博时黄金 ETF	博时黄金 ETF 场外 D 类	博时黄金 ETF 场外 I 类
下属分级基金的交易代码	159937	000929	000930
报告期末下属分级基金的份额总额	321,421,977.00 份	3,183,707.50 份	468,093,691.89 份

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	本基金主要采取被动式管理策略。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。
业绩比较基准	黄金现货实盘合约 AU99.99 收益率
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	王永民
	联系电话	0755-83169999	010-66594896
	电子邮箱	service@bosera.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105568	95566
传真		0755-83195140	010-66594942

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）		
	博时黄金 ETF	博时黄金 ETF 场外 D 类	博时黄金 ETF 场外 I 类
本期已实现收益	40,286,328.02	345,729.52	92,063,040.93
本期利润	129,079,919.43	726,114.75	268,652,422.36
加权平均基金份额本期利润	0.5666	0.4572	0.5389
本期基金份额净值增长率	26.49%	26.84%	26.39%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2016 年 6 月 30 日)**		
	博时黄金 ETF	博时黄金 ETF 场外 D 类	博时黄金 ETF 场外 I 类
期末可供分配基金份额利润	-3.4432	0.1620	0.1641
期末基金资产净值	904,099,104.98	9,020,277.21	1,318,749,752.27
期末基金份额净值	2.8128	2.8333	2.8173

注：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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指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。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

博时黄金 ETF

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	9.61%	1.39%	9.58%	1.41%	0.03%	-0.02%
过去三个月	10.12%	1.02%	10.09%	1.03%	0.03%	-0.01%
过去六个月	26.49%	1.03%	26.31%	1.03%	0.18%	0.00%
过去一年	20.15%	0.97%	19.82%	0.97%	0.33%	0.00%
自基金合同生	10.45%	0.93%	8.27%	0.96%	2.18%	-0.03%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

效起至今						

博时黄金 ETF 场外 D 类

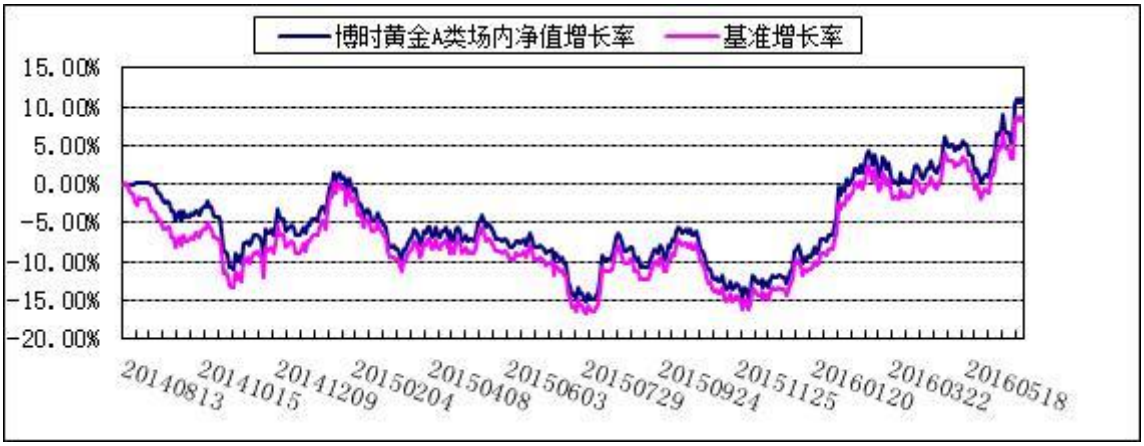
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	9.61%	1.39%	9.58%	1.41%	0.03%	-0.02%
过去三个月	10.18%	1.02%	10.09%	1.03%	0.09%	-0.01%
过去六个月	26.84%	1.02%	26.31%	1.03%	0.53%	-0.01%
过去一年	20.67%	0.96%	19.82%	0.97%	0.85%	-0.01%
自基金合同生效起至今	26.75%	0.98%	17.12%	0.93%	9.63%	0.05%

博时黄金 ETF 场外 I 类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	9.58%	1.39%	9.58%	1.41%	0.00%	-0.02%
过去三个月	10.07%	1.02%	10.09%	1.03%	-0.02%	-0.01%
过去六个月	26.39%	1.03%	26.31%	1.03%	0.08%	0.00%
过去一年	20.04%	0.96%	19.82%	0.97%	0.22%	-0.01%
自基金合同生效起至今	17.52%	0.92%	17.12%	0.93%	0.40%	-0.01%

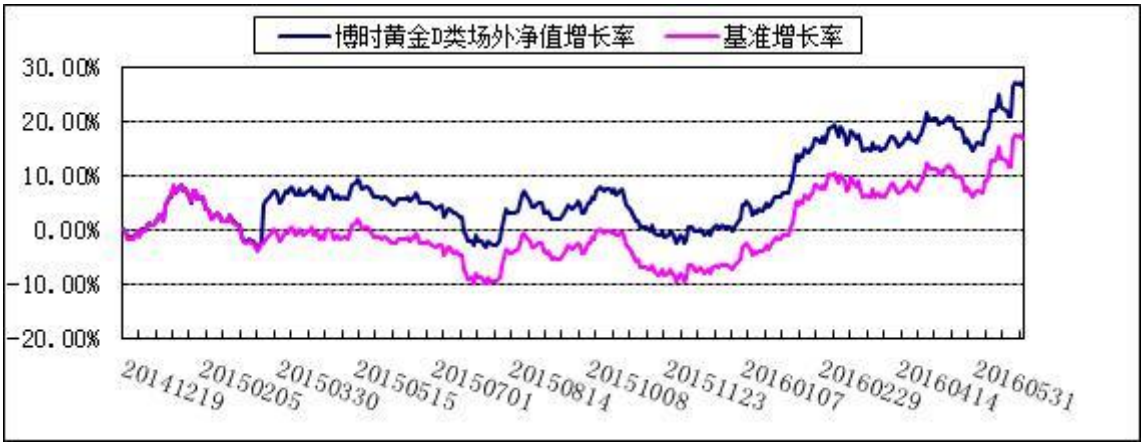
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1、博时黄金 ETF



2、博时黄金 ETF 场外 D 类

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站



3．博时黄金 ETF 场外 I 类：

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2016 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 117 只开放式基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户。资产管理净值总规模达 4,598.72 亿元人民币，其中公募基金资产规模 2497.59 亿元人民币，累计分红 724.58 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一，养老金资产管理规模在同业中名列前茅。

1、 基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，2016 年二季度，博时旗下基金业绩依然领先。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

截至 6 月 30 日，偏股型基金中，行业轮动、创业成长、博时主题基金，今年以来净值增长率在同类型 374 只基金中排名前 1/10；标准指数股票型基金中，博时淘金 100 大数据、博时上证自然资源 ETF、中证银行指数分级基金，今年以来净值增长率在同类型 326 只基金中都排名在前 1/8；ETF 联接基金里，上证资源 ETF 联接今年以来净值增长率在同类 66 只中排名第二；灵活配置型基金里，博时灵活配置 A 今年以来净值增长率在同类 290 只排名前 1/10；保本型基金里，博时招财一号保本混合，今年以来净值增长率在同类 51 只中排名前 1/7；博时黄金 ETF 场外 D 类今年以来净值增长率为 27.5%，在同类 8 只排名第一。

固定收益方面，长期标准债券型基金中，博时信用债纯债基金今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；指数债券型基金里，博时上证企债 30ETF 今年以来净值增长率在同类排名前 1/8；货币市场基金里，博时外服货币，今年以来净值增长率在同类 194 只排名第四，博时现金收益货币，今年以来净值增长率在同类 194 只基金中排名前 2/5；博时安丰 18 定期开放债券，今年以来净值增长率在同类 45 只中排名第四。

QDII 基金中，博时亚洲票息，今年以来至 6 月 30 日净值增长 7.12%，在同类 QDII 债券基金 11 只中排名第二。

2、其他大事件

•2016 年 6 月 24 日，由南方日报主办的一年一度“金榕奖”南方金融大奖系列评选正式揭晓，博时基金董事长张光华荣膺“2016 南方金融领导力年度大奖”，博时基金基金经理魏桢荣获“2016 南方金融年度投资理财师”称号。

•由中国基金报、香山财富论坛、深圳市政府金融办、国泰基金联合主办的“中国机构投资者峰会暨财富管理国际论坛”2016 年 5 月 13 日在深举行。博时旗下博时信用债券获得“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。

•2016 年 5 月 10 日，由上海证券报主办的 2016 中国基金业峰会暨第十三届“金基金”奖颁奖典礼在上海举办，博时基金凭借在固定收益投资领域的突出表现，荣获“2015 年度金基金 • 债券投资回报基金管理公司”大奖。

•2016 年 3 月 27 日，第十三届中国基金业金牛奖揭晓，博时基金凭借在固定收益产品出色的业绩表现摘得了基金业的“奥斯卡”奖----“固定收益投资金牛基金公司”奖。wind 数据显示，2015 年博时基金旗下 10 只纯债产品平均收益率达 12.65%，其中 6 只定期开放债基平均收益率更高达 15.17%，博时安丰 18 个月定期开放债券和博时双月

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

薪双双夺得同类基金收益榜冠军。

•2016 年 3 月 15 日，由腾讯证券主办的《“挑战 机遇”315 评选——投资者最认同的券商、基金领军人物》评选活动日前揭晓，博时基金董事长张光华先生获评“投资者最认同的公募基金领军人物”，网络票选高居第二位。

•2016年1月18日，大众证券报“2015中国基金风云榜”上，博时创业成长（050014）荣获2015“最受投资者喜爱基金”奖、博时安丰18个月定开债（160515）荣获2015“最佳固定收益型基金”奖。

•2016 年 1 月 15 日，2016 年金融理财创新与发展论坛暨第六届“金貔貅”奖颁奖盛典在京举办，博时基金获评年度金牌品牌力、金牌创新力两项大奖；博时“存金宝”获年度金牌创新力金融产品奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵云阳	基金经理	2015-10-08	-	5.8	2003 年至 2010 年在晨星中国研究中心工作。2010 年加入博时基金管理有限公司，历任量化分析师、基金经理助理、博时特许价值股票基金、博时招财一号保本基金、博时中证淘金大数据 100 基金、博时沪深 300 指数基金基金经理。现任博时深证基本面200ETF基金兼博时深证基本面 200ETF 联接基金、上证企债 30ETF 基金、博时证券保险指数分级基金、博时黄金 ETF 基金、博时上证 50ETF 基金、博时上证 50ETF 联接基金、博时银行分级基金、博时黄金 ETF 联接基金的基金经理。
王祥	基金经理助理	2015-11-23	-	0.6	2006 年起先后在中粮期货、中国工商银行总行工作。2015 年 11 月加入博时基金管理有限公司，任指数投资部基金经理助理

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2016 年上半年，黄金市场展现了非凡的活力。1 季度在全球金融市场大幅波动的背景下，黄金避险属性被有效激发，全球黄金 ETF 规模 1 季度猛增 363 吨，国际金价扶摇直上获得 16.16%的单季亮眼表现。之后随着美国经济数据表现的起伏与美联储加息预期的不断调整，国际金价在二季度出现了较大的震荡，在 1200~1300 美元区间内数度起落。但最终随着英国脱欧等风险事件的推动，国际金价最终仍发力上行，成功站上 1300 美元关口，年内涨幅 24.3%，成为表现最为突出的资产之一。

本基金为被动跟踪标的指数的基金。其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得标的指数所代表的市场平均回报。在本报告期内，我们除了争取紧密跟踪上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格、取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现外，在严格控制基金流动性风险的前提下，本基金管理人进行了部分黄金租赁业务，积极为持有人谋求基金资产的增值，并为投资人提供了多次分红。本基金今年以来截止 6 月 30 日，取得了相对业绩基准 0.15%的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金场内份额净值为 2.8128 元，份额累计净值为 1.1045 元；I 类场外份额净值为 2.8173 元，份额累计净值为 1.1745 元；D 类场外份额净值为

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

2.8333 元，份额累计净值为 1.2600 元。报告期内本基金场内份额净值增长率为 26.49%，同期业绩基准涨幅为 26.31%；I 类场外份额净值增长率为 26.39%，同期业绩基准涨幅为 26.31%；D 类场外份额净值增长率为 26.84%，同期业绩基准涨幅为 26.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为黄金市场仍有进一步上行的空间，但整体存在先扬后抑的可能 。

近期受美国数据表现不佳的拖累以及英国脱欧等风险事件的影响，美联储加息步伐有放缓的趋势。议息点阵图有所下移，但从中期的角度看，美联储年内继续加息一次概率仍较大，美元指数对黄金的压力将会在利率决议前夕反复发酵。特别是由于年末将迎来美国大选，出于考虑金融政治稳定的角度出发，三季度进行本次加息的概率较高。

一旦本次加息靴子落地，在全球整体仍坚持宽松格局的背景下，市场实际利率的低迷将使黄金持续受到追捧，价格区间有望逐步抬高。但随着时间的推移，国际原油价格向着页岩油成本逐渐靠近，远期的油价有望重新激活页岩油产能并对原油价格形成压制，从而拖累全球整体通胀表现。另一方面，国内证券投资领域地产与股市的跷跷板效应以及领先周期的推断，年末股市预期有望改善，削弱黄金避险属性，故下半年黄金市场整体存在先扬后抑可能。

投资策略上，博时黄金 ETF 作为一只被动投资的基金，我们会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪目标基准，并通过黄金租赁业务，为投资者创造黄金生息的收益。我们希望通过博时黄金 ETF 基金为投资人提供长期保值和中短期避险的良好投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的副总经理、督察长、投资总监、研究部负责人、风险管理部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金以使收益分配后基金累计收益率尽可能贴近标的指数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：基金收益评价日核定的本基金 I 类场外份额的基金累计收益率超过标的指数同期累计收益率达到 0.01%以上，本基金 I 类场外份额方可进行收益分配；基金收益评价日核定的本基金场内份额及 D 类场外份额的基金累计收益率超过标的指数同期累计收益率达到 1%以上，本基金场内份额及 D 类场外份额方可进行收益分配；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金 I 类场外份额可进行收益分配；基金合同生效不满三个月，本基金 I 类场外份额收益可不分配。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金场内份额及 D 类场外份额的收益分配每年至多 2 次；每次收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 5%；基金合同生效不满三个月，本基金场内份额及 D 类场外份额收益可不分配；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。

本基金 I 类本报告期内向份额持有人分配利润 2,058,857.17 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对博时黄金交易型开放式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：博时黄金交易型开放式证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	3,409,451.09	313,193.20
结算备付金	199,596,375.13	8,298,501.83
存出保证金	5,212,099.20	1,951,250.00
交易性金融资产	2,143,422,635.00	1,402,761,069.60
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	2,143,422,635.00	1,402,761,069.60
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	3,746,707.68	2,788,632.35
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

其他资产	-	-
资产总计	2,355,387,268.10	1,416,112,646.98
负债和所有者权益	**本期末 2016 年 6 月 30 日**	**上年度末 2015 年 12 月 31 日**
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	3,437,280.00	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	1,331,845.41	-
应付赎回款	117,344,982.43	11,871,652.20
应付管理人报酬	911,491.68	567,801.01
应付托管费	182,298.33	113,560.27
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	310,235.79	156,114.34
负债合计	123,518,133.64	12,709,127.82
所有者权益：		
实收基金	1,953,016,491.29	1,549,852,938.70
未分配利润	278,852,643.17	-146,449,419.54
所有者权益合计	2,231,869,134.46	1,403,403,519.16
负债和所有者权益总计	2,355,387,268.10	1,416,112,646.98

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金场内份额净值 2.8128 元， D 类场外份额净值为 2.8333 元，I 类场外份额净值为 2.8173 元。场内份额为 321,421,977.00 份，D 类场外份额为 3,183,707.50 份，I 类场外份额为 468,093,691.89 份。

6.2 利润表

会计主体：博时黄金交易型开放式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入	**407,342,956.03**	**-5,211,062.33**
1.利息收入	9,125,736.22	2,140,832.07
其中：存款利息收入	237,427.39	15,686.10
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

其他利息收入	8,888,308.83	2,125,145.97
2.投资收益（损失以“-”填列）	131,461,329.53	-158,152.32
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	128,153,747.05	26,746.46
衍生工具收益	3,307,582.48	-184,898.78
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	265,763,358.07	-7,219,789.58
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	992,532.21	26,047.50
减：二、费用	**8,884,499.49**	**1,630,674.62**
1．管理人报酬	4,618,030.31	578,629.71
2．托管费	923,606.06	115,725.84
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	2,905,641.73	698,899.44
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．其他费用	437,221.39	237,419.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	**398,458,456.54**	**-6,841,736.95**
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	**398,458,456.54**	**-6,841,736.95**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：博时黄金交易型开放式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,549,852,938.70	-146,449,419.54	1,403,403,519.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	398,458,456.54	398,458,456.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	403,163,552.59	28,902,463.34	432,066,015.93
其中：1.基金申购款	9,102,873,015.31	677,597,721.32	9,780,470,736.63

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

2. 基金赎回款	-8,699,709,462.72	-648,695,257.98	-9,348,404,720.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-2,058,857.17	-2,058,857.17
五、期末所有者权益（基金净值）	1,953,016,491.29	278,852,643.17	2,231,869,134.46
项目	**上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	23,204,792.65	-262,513.98	22,942,278.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,841,736.95	-6,841,736.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	502,566,731.51	-4,469,441.17	498,097,290.34
其中：1. 基金申购款	1,382,465,106.35	-2,882,472.45	1,379,582,633.90
2. 基金赎回款	-879,898,374.84	-1,586,968.72	-881,485,343.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-530,542.82	-530,542.82
五、期末所有者权益（基金净值）	525,771,524.16	-12,104,234.92	513,667,289.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ _____ _____

基金管理人负责人：江向阳　主管会计工作负责人：王德英　会计机构负责人：成江

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,618,030.31	578,629.71
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.5%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	923,606.06	115,725.84

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,409,451.09	10,029.77	686,988.52	840.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)基金申购款

于 2016 年 6 月 30 日，本基金申购基金份额的对价总额为 636,948,702.51 元(2015 年度：629,705,774.67 元)，其中包括以黄金合约支付的申购款 91,774,543.56 元(2015 年度： 18,988,260.00)和以现金支付的申购款 545,174,158.95 元(2015 年度：610,717,514.67 元)。

(2)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,143,422,635.00 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 1,402,761,069.60 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(于 2015

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(3)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	2,143,422,635.00	91.00
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	203,005,826.22	8.62
7	其他各项资产	8,958,806.88	0.38
8	合计	2,355,387,268.10	100.00

7.2 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。

7.3 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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

金额单位：人民币元

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	7,614,290.00	2,143,422,635.00	96.04

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,212,099.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,746,707.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,958,806.88

7.12.4 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可转债。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构					
			机构投资者		个人投资者		博时黄金 ETF 联接基金	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时黄金 ETF	2,620	122,680.14	205,046,303.00	63.79%	109,665,674.00	34.12%	6,710,000.00	2.09%
博时黄金 ETF 场外 D 类	206	15,454.89	9,083.96	0.29%	3,174,623.54	99.71%	-	-
博时黄金 ETF 场外 I 类	789,007	593.27	-	-	468,093,691.89	100.00%	-	-
合计	791,833	1,001.09	205,055,386.96	25.87%	580,933,989.43	73.29%	6,710,000.00	0.85%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	前海开源基金－浙商银行－前海开源战略 3 号资产管理计划	149,694,000.00	46.57%
2	周夏真	31,000,000.00	9.64%
3	叶玉莲	30,000,084.00	9.33%
4	王中秋	19,000,092.00	5.91%
5	华润深国投信托有限公司－赤子之心招商单一信托计划	15,600,000.00	4.85%
5	中信证券股份有限公司	9,287,800.00	2.89%
7	华润深国投信托有限公司－民森 H 号证券投资集合资金信托计划	6,783,800.00	2.11%
8	建信期货有限责任公司－建信期货－双	4,147,484.00	1.29%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	辉 3 号资产管理计划		
9	方正证券股份有限公司	3,058,700.00	0.95%
10	招商财富－招商银行－招商财富资产管理有限公司	2,851,600.00	0.89%
	黄金 ETF 联接基金	6,710,000.00	2.09%

注：上述基金份额持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	博时黄金 ETF	-	-
	博时黄金 ETF 场外 D 类	140,877.51	4.42%
	博时黄金 ETF 场外 I 类	159,564.61	0.03%
	合计	300,442.12	0.04%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时黄金 ETF	-
	博时黄金 ETF 场外 D 类	0~10
	博时黄金 ETF 场外 I 类	0~10
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时黄金 ETF	-
	博时黄金 ETF 场外 D 类	-
	博时黄金 ETF 场外 I 类	-
	合计	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
2、本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时黄金 ETF	博时黄金 ETF 场外 D 类	博时黄金 ETF 场外 I 类
本报告期期初基金份额总额	244,321,977.00	371,873.72	384,974,452.63
本报告期基金总申购份额	238,800,000.00	5,574,142.97	3,523,334,325.74
减：本报告期基金总赎回份额	161,700,000.00	2,762,309.19	3,440,215,086.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	321,421,977.00	3,183,707.50	468,093,691.89

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

博时基金管理有限公司

二〇一六年八月二十五日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站