

# 博时黄金交易型开放式证券投资基金

## 2016 年年度报告(摘要)

2016 年 12 月 31 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：二〇一七年三月二十七日

## § 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 2017 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 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	1,846,099,911.20 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	164,521,977.00 份	23,409,364.02 份	1,658,168,570.18 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	

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

#### 1. 博时黄金 ETF:

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 8 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
	博时黄金 ETF	博时黄金 ETF	博时黄金 ETF
本期已实现收益	79,881,999.35	-720,710.06	-8,326.58
本期利润	75,994,653.23	-34,326,719.47	216,427.78

加权平均 基金份额 本期利润	0.2627	-0.3868	0.0055
本期基金 份额净值 增长率	18.87%	-7.80%	-5.30%
3.1.2 期末 数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
	博时黄金 ETF	博时黄金 ETF	博时黄金 ETF
期末可供 分配基金 份额利润	-3.3776	-3.5869	-0.1349
期末基金 资产净值	434,901,530.74	543,294,069.77	5,359,251.12
期末基金 份额净值	2.6434	2.2237	2.4119

## 2. 博时黄金 ETF 场外 D 类:

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 8 月 13 日 (基 金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
	博时黄金 ETF 场外 D 类	博时黄金 ETF 场外 D 类	博时黄金 ETF 场外 D 类
本期已实 现收益	1,329,657.51	5,594.65	27.34
本期利润	-5,968,489.33	118,086.49	68.49
加权平均 基金份额 本期利润	-0.5994	0.4223	0.0102
本期基金	19.10%	-0.33%	0.26%

份额净值 增长率			
3.1.2 期末 数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
	博时黄金 ETF 场外 D 类	博时黄金 ETF 场外 D 类	博时黄金 ETF 场外 D 类
期末可供 分配基金 份额利润	0.2560	0.0013	0.0040
期末基金 资产净值	62,275,978.50	894,579.74	18,959.04
期末基金 份额净值	2.6603	2.4056	2.4136

## 3. 博时黄金 ETF 场外 I 类:

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年 8 月 13 日 (基 金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
	博时黄金 ETF 场外 I 类	博时黄金 ETF 场外 I 类	博时黄金 ETF 场外 I 类
本期已实 现收益	146,461,143.04	-3,520,650.27	13,992.85
本期利润	68,614,871.22	-25,265,423.84	121,859.24
加权平均 基金份额 本期利润	0.0954	-0.1436	0.0596
本期基金 份额净值 增长率	18.38%	-7.21%	0.21%
3.1.2 期末 数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
	博时黄金 ETF 场外 I 类	博时黄金 ETF 场外 I 类	博时黄金 ETF 场外 I 类

期末可供分配基金份额利润	0.2302	-0.1753	0.0028
期末基金资产净值	4,373,185,919.60	859,214,869.65	17,564,068.51
期末基金份额净值	2.6374	2.2319	2.4124

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

##### 1. 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
过去三个月	-7.29%	0.88%	-7.39%	0.89%	0.10%	-0.01%
过去六个月	-6.02%	0.79%	-6.25%	0.80%	0.23%	-0.01%
过去一年	18.87%	0.92%	18.42%	0.93%	0.45%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.79%	0.90%	1.50%	0.92%	2.29%	-0.02%

##### 2. 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
过去三个月	-7.26%	0.89%	-7.39%	0.89%	0.13%	0.00%
过去六个月	-6.11%	0.79%	-6.25%	0.80%	0.14%	-0.01%
过去一年	19.10%	0.92%	18.42%	0.93%	0.68%	-0.01%
自基金合同生效起至今	19.01%	0.94%	9.80%	0.90%	9.21%	0.04%

3. 博时黄金 ETF 场外 I 类:

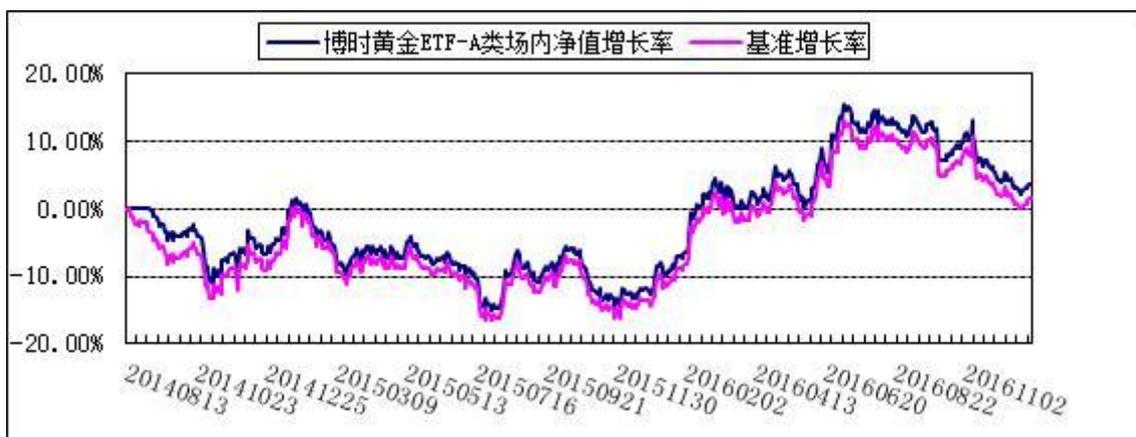
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.41%	0.89%	-7.39%	0.89%	-0.02%	0.00%
过去六个月	-6.34%	0.79%	-6.25%	0.80%	-0.09%	-0.01%
过去一年	18.38%	0.92%	18.42%	0.93%	-0.04%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.07%	0.89%	9.80%	0.90%	0.27%	-0.01%

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

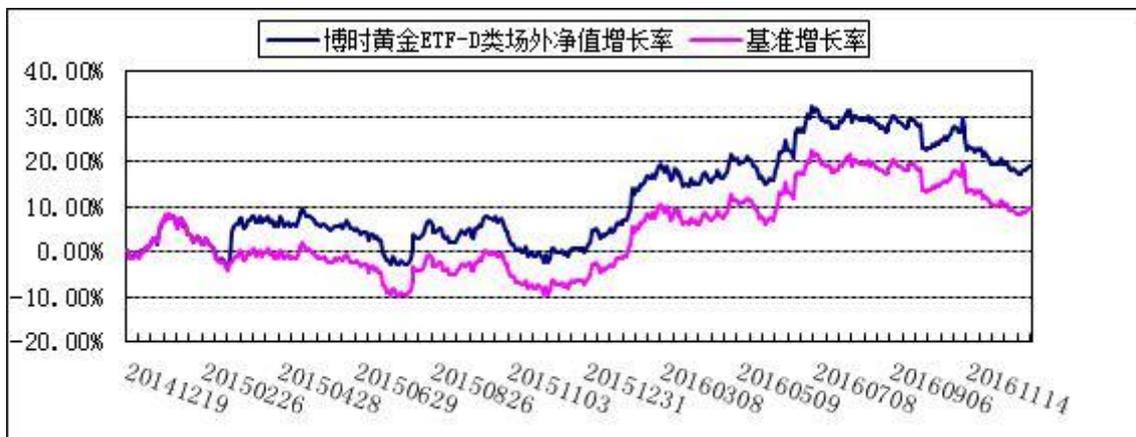
博时黄金交易型开放式证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2014 年 8 月 13 日至 2016 年 12 月 31 日)

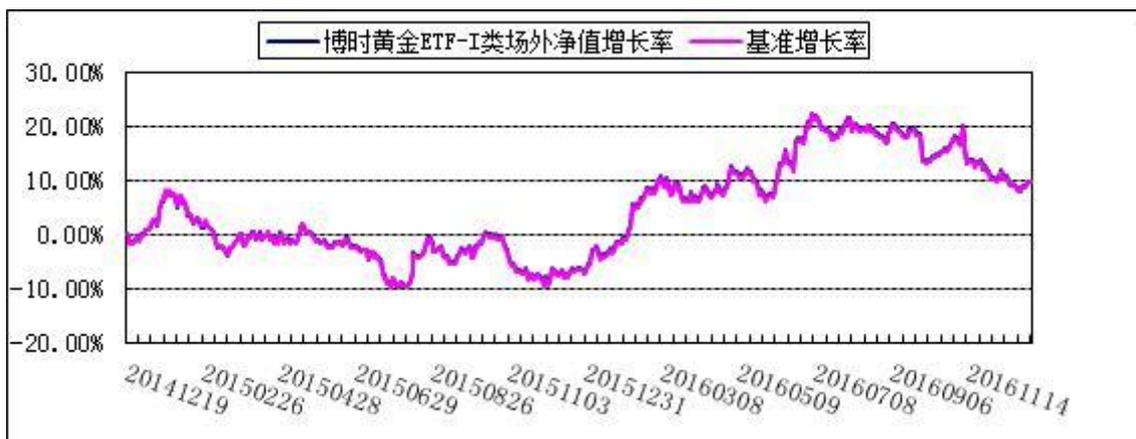
1、博时黄金 ETF



2、博时黄金 ETF 场外 D 类



3、博时黄金 ETF 场外 I 类

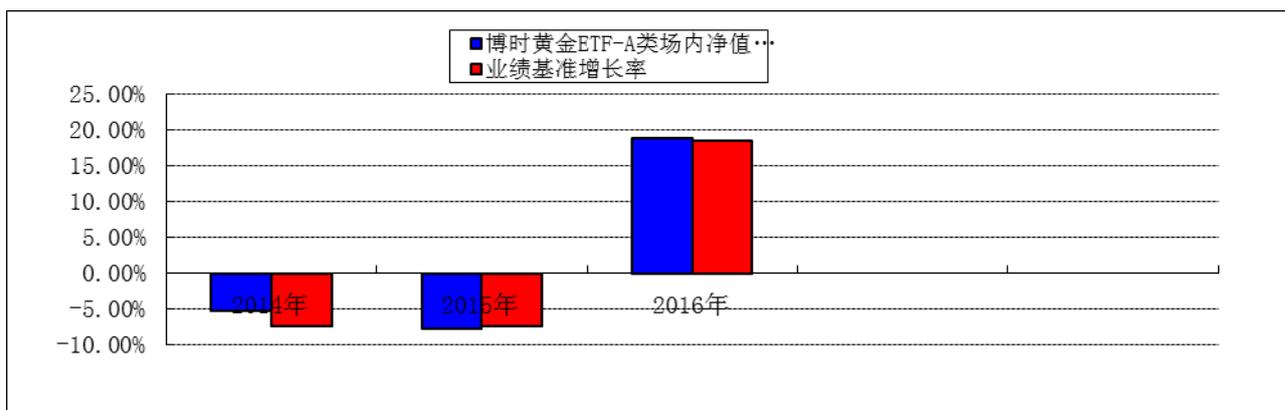


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

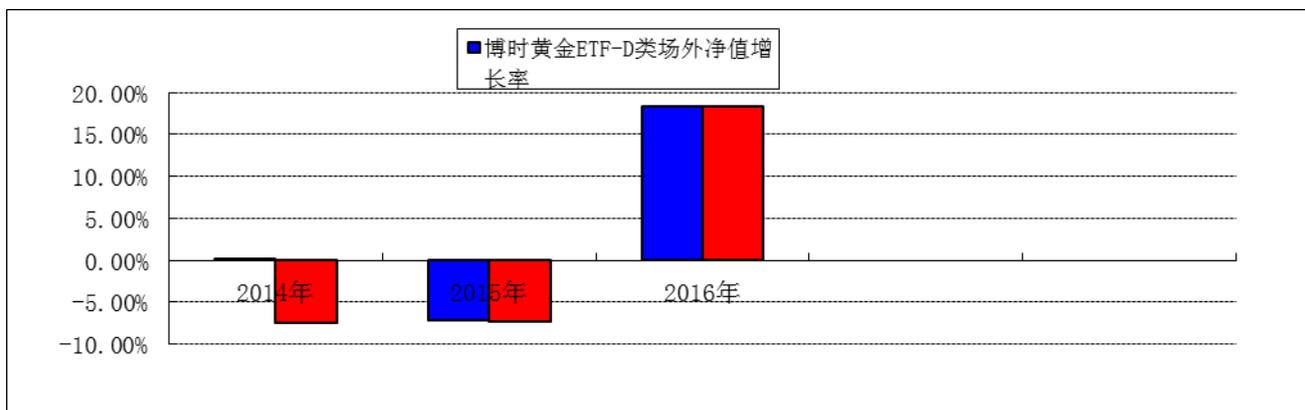
博时黄金交易型开放式证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

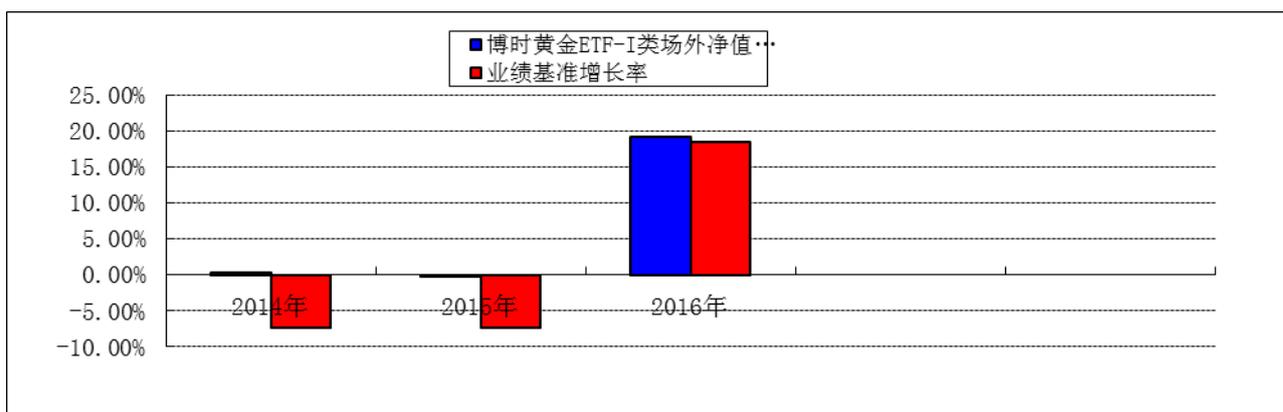
1、博时黄金 ETF



2、博时黄金 ETF 场外 D 类



### 3、博时黄金 ETF 场外 I 类



注：本基金的基金合同于 2014 年 8 月 13 日生效。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 2、博时黄金 ETF 场外 D 类：

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016 年	2.000	324,760.07	-	324,760.07	-
合计	2.000	324,760.07	-	324,760.07	-

#### 3、博时黄金 ETF 场外 I 类：

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016 年	0.046	-	2,936,999.83	2,936,999.83	-
2015 年	0.068	-	1,182,598.74	1,182,598.74	-
合计	0.114	-	4,119,598.57	4,119,598.57	-

## § 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 12

月 31 日, 博时基金公司共管理 164 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, 管理资产总规模逾 6250 亿元人民币, 其中公募基金规模逾 3760 亿元人民币, 累计分红逾 781 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, 截至 2016 年年末, 博时旗下共 94 只(份额分开计算) 成立满一年的基金产品参与分类排名。其中排名在同类前 1/2 的产品共有 60 只(主动权益 17 只, 债券 16 只, 指数 20 只, 货币 3 只, QDII 基金 4 只), 约 64%; 排名在前 1/3 的产品共有 45 只, 约 48%; 排名前 1/4 的产品共有 34 只, 约 36%。博时旗下各类产品均有表现突出的产品位居行业前列。

黄金基金类, 博时黄金 ETF(D 类) 今年以来净值增长率 19.10%, 在同类 8 只排名第 1。

固收方面, 长期标准债券型基金里, 博时双月薪定期支付债券, 今年以来净值增长率为 6.54%, 在同类 61 只中排名第 2; 博时信用债纯债(A 类), 今年以来净值增长率为 4.23%, 在同类中排名第 4; 中短期标准债券型基金, 博时安盈债券(A 类) 今年以来净值增长率为 2.02%, 在同类 66 只排名第 1; 普通债券型基金里, 博时稳定价值债券(A 类) 今年以来净值增长率为 2.31%, 在同类排名前 1/3; 货币市场基金里, 博时外服货币今年以来净值增长率为 3.03%, 同类 194 只排名第 6。

QDII 基金, 博时标普 500ETF 今年以来净值增长率 18.34%, 同类排名前 1/4。博时亚洲票息收益债券(QDII) 今年以来净值增长率 14.43%, 同类排名第 3。

### 2、其他大事件

- 2016 年 12 月 27 日, 2016 金融新媒体峰会暨金 V 榜 2016 颁奖典礼在广州举行, 博时基金荣获“最具传播力基金公司”奖项。

- 2016 年 12 月 13 日, 由中国经营报主办的“2016 第十四届中国企业竞争力年会暨金融高峰论坛”在北京举行, 博时基金荣获“2016 卓越竞争力品牌建设金融机构”奖项。

- 2016 年 12 月 9 日, 在证券日报主办的“第十二届中国证券市场年会”上, 博时基金荣膺中国证券市场“2016 年度最全能公募基金龙鼎奖”。

- 2016 年 12 月 8 日, 金融界网站主办的首届智能金融国际论坛暨第五届金融界“领航中国”年度盛典, 博时基金荣获“2016 年杰出品牌奖”。

- 2016 年 12 月 6 日, 全国社会保障基金理事会发布公告, 博时成为基本养老保险基

金首批证券投资基金管理机构之一。

- 2016 年 12 月 1 日, 由《经济观察报》主办的“2015-2016 年度观察家金融峰会”在沪举办, 博时基金再次独家蝉联“卓越固定收益投资团队奖”。

- 2016 年 11 月 25 日, 由北大汇丰商学院、南方都市报、奥一网联合主办的 2016 年(第二届)CFAC 中国金融年会在深召开, 博时基金再次蝉联“年度最佳基金公司大奖”。

- 2016 年 11 月 23 日, 由新浪财经主办的“2016 新浪全球资产管理论坛”在京举行, “2016 中国(首届)波特菲勒奖综合评选”结果揭晓。博时基金荣获“2016 最具互联网创新基金公司”、基金经理过钧获评“2016 最佳债券基金经理”、何凯获“2016 最佳 QDII 基金经理”。本届波特菲勒奖博时基金共斩获三项大奖, 成为获奖最多的公募基金基金公司之一。

- 2016 年 11 月 17 日, 全国社保基金境内投资管理人 2016 年座谈会在上海举行, 博时基金副总裁董良泓荣获“五年服务社保奖”, 该奖项授予长期为社保服务且业绩优秀的投资管理人, 本次仅授予 5 人, 董良泓先生是自 2015 年之后再次蝉联该奖项。

- 2016 年 9 月 7 日, 第二届结构性融资与资产证券化论坛暨 2016 年度资产证券化·介甫奖颁奖典礼上, “博时资本-平安银行橙鑫橙 e 资产支持专项计划”荣获“应收账款类最受投资者欢迎产品”和“最佳风控产品”两项大奖。

- 2016 年 8 月 5 日, 由 21 世纪经济报道主办的“2016 深港通论坛暨‘金帆奖’系列颁奖礼上, 博时一举斩获 2016 年综合实力十强基金公司奖、2016 年互联网突出表现奖、2016 年 ABS 最具实力管理人奖(博时资本)三项大奖。

- 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, 博时基金荣获“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”大奖。

- 2016 年 4 月 15 日, 由中国基金报主办的第三届中国基金业英华奖评选揭晓, 博时基金经理过钧先生获评三年期二级债基最佳基金经理、五年期二级债基最佳基金经理。

•2016年3月27日,第十三届中国基金业金牛奖揭晓,博时基金摘得了基金业的“奥斯卡”奖——“固定收益投资金牛基金公司”奖。

•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	-	6.3	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	2016-11-02	-	1.1	2006年起先后在中粮期货、工商银行总行工作。2015年加入博时基金管理有限公司,曾任基金经理助理。现

					任博时黄金 ETF 基金兼博时黄金 ETF 联接基金、博时上证自然资源 ETF 基金、博时上证自然资源 ETF 联接基金的基金经理。
王祥	基金经理助理	2015-11-23	2016-11-01	1.1	2006 年起先后在中粮期货、工商银行总行工作。2015 年加入博时基金管理有限公司，曾任基金经理助理。现任博时黄金 ETF 基金兼博时黄金 ETF 联接基金、博时上证自然资源 ETF 基金、博时上证自然资源 ETF 联接基金的基金经理。

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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了《公平交易管理制度》，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

##### 4.3.2 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。

##### 4.3.3 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

2016 年,黄金市场在历经了过去数年的黯淡之后终于强势归来,包括英国脱欧、美国大选在内的地缘政治事件频发,以及主要经济体的货币政策差异所导致的全球金融市场的剧烈波动都极大的激发了市场的避险需求,黄金作为传统的避险资产在整体收益率下行的过程中再次受到追捧。2016 年,国际金价一度冲高至 1375 美元,巅峰涨幅接近 30%,之后随着全球货币政策反转的影响,金价在四季度出现了明显的回落,但整体仍录得 8.6% 的年度涨幅,同时全球最大黄金 ETF 全年净增 180 吨,超出之前 2 年的流出总和,显示长期配置资金开始关注黄金市场。在人民币贬值的影响下,国内金价表现更为耀眼,全年总体收涨 18.42%,成为抵御汇率波动的有效工具。

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,并为本基金的 I 类份额投资人提供了多次分红。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日,本基金场内基金份额净值为 2.6434 元,份额累计净值为 1.0379 元;I 类基金份额净值为 2.6374 元,份额累计净值为 1.1003 元;D 类基金份额净值为 2.6603 元,份额累计净值为 1.1882 元。报告期内,本基金场内基金份额净值增长率为 18.87%,I 类基金份额净值增长率为 18.38%,D 类基金份额净值增长率为 19.10%,同期业绩基准增长率 18.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年的黄金市场目前定位于震荡反弹。与 2016 年相比,2017 年的行情可能不那么波澜壮阔。影响黄金的根本逻辑在于实际利率的表现,2016 年上半年资产荒横行,全球流动性充裕的背景下避险情绪与原油反弹所带来的通胀上升预期交织,美国受其他经济体拖累而放缓升息路径,导致实际利率下行提升金价。2016 年下半年开始货币政策风向已经转变,由原先的非美经济体拖累美国,向美国引领非美经济体货币政策出现拐点转变。在 2017 年美国已进入实际升息周期的影响下,加息路径与通胀上行的赛跑是左右实际利率的最重要因素,受其拖累,黄金的反弹之路注定不平坦。从时间节点上看,一季度特朗普正式就任,但其政策开始发挥效应尚需一段时间,即 2017 年上半年美联

储可能更多倾向于观察经济表现与特朗普政策的影响，其主动升息概率不高，给实际利率留出下行空间，利好金价。同时法国二季度大选前，避险情绪也将继续推升金价反弹。但由于法国大选两轮投票的机制与之前的英国脱欧及美国大选不同，极端势力当选的可能性非常低。伴随避险退潮和美联储开始行动，年中时段的黄金市场可能重新归于调整。四季度有两个潜在的分化方向，一是随着欧元区、日本等经济表现趋暖，上述央行的货币政策跟上美联储的步伐，跨区域间的套息交易结束，美元高点确立，金价开始反转走升。另一个可能是 16 年下半年开始的边际收紧挫伤了欧洲和日本的经济恢复，使其重回宽松的老路，这在初期将对金价构成较大伤害，但在美联储受累重新调整其加息步伐后，黄金将重启反弹之路。因此 2017 年关注的重点在于各经济体的经济数据表现能否支撑当下的货币及财政政策，以及后续的政策变化所引发的套息交易路径的改变。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在完善内部控制制度和流程手册的同时，推动内控体系和制度措施的落实；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司监察法律部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事、总经理和监管部门出具监察稽核报告。

2016 年，我公司根据法律、法规的规定，制定、修订和完善了《博时货币市场基金投资管理制度》、《博时基金国债期货投资管理流程手册》、《博时基金国债期货风险管理流程手册》、《博时基金流动性风险管理制度》、《关联交易管理办法》、《交易部公平交易管理制度》、《博时 ETF 基金风险管理制度》、《博时基金反洗钱工作手册》、《开放式基金业务规则》等制度和流程手册等制度。定期更新了各公募基金的《投资管理细则》，以制度形式明确了投资管理相关的内部流程及内部要求。不断完善“博时客户关系管理系统”、“博时投资决策支持系统”等管理平台，加强了公司的市场体系、投研体系和后台运作的风险监控工作。在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》的规定审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 D 类本报告期内向份额持有人分配利润 0.20 元。

本基金 I 类本报告期内向份额持有人分配利润 0.0046 元。

#### 4.9 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 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于博时基金管理公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款		11,755,316.40	313,193.20
结算备付金		63,913,213.12	8,298,501.83
存出保证金		6,472,165.00	1,951,250.00
交易性金融资产		4,869,237,373.00	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		4,869,237,373.00	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		1,830.69	-
应收利息		8,022,109.71	2,788,632.35
应收股利		-	-
应收申购款		5,100.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>4,959,407,107.92</b>	<b>1,416,112,646.98</b>
负债和所有者权益		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		11,875,500.00	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		23,710,050.00	-
应付赎回款		50,812,579.08	11,871,652.20
应付管理人报酬		1,989,018.50	567,801.01
应付托管费		397,803.71	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		0.03	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		258,727.76	156,114.34
<b>负债合计</b>		<b>89,043,679.08</b>	<b>12,709,127.82</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金		4,466,796,097.01	1,549,852,938.70
未分配利润		403,567,331.83	-146,449,419.54
<b>所有者权益合计</b>		<b>4,870,363,428.84</b>	<b>1,403,403,519.16</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>4,959,407,107.92</b>	<b>1,416,112,646.98</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,846,099,911.20 份。其中场内基金份额为 164,521,977.00 份，基金份额净值 2.6434 元，D 类基金份额为 23,409,364.02 份，基金份额净值 2.6603 元，I 类基金份额为 1,658,168,570.18 份，基金份额净值 2.6374 元。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
<b>一、收入</b>	<b>163,609,413.71</b>	<b>-53,519,464.29</b>	
1. 利息收入	21,729,234.16	7,272,714.58	
其中：存款利息收入	565,589.93	67,876.74	
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	-	-	
其他利息收入	21,163,644.23	7,204,837.84	
2. 投资收益（损失以“-”填列）	225,362,621.48	-5,802,033.16	
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	227,456,143.21	-4,918,679.89	
衍生工具收益	-2,093,521.73	-883,353.27	
股利收益	-	-	
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-89,031,764.78	-55,238,291.14	
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,549,322.85	248,145.43	
<b>减：二、费用</b>	<b>24,968,378.59</b>	<b>5,954,592.53</b>	
1. 管理人报酬	13,556,277.31	3,008,735.95	
2. 托管费	2,711,255.46	601,747.32	
3. 销售服务费	-	-	
4. 交易费用	7,334,613.20	1,691,423.86	
5. 利息支出	-	-	
其中：卖出回购金融资产支出	-	-	

6. 其他费用		1,366,232.62	652,685.40
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		138,641,035.12	-59,474,056.82
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		138,641,035.12	-59,474,056.82

### 7.3 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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)	-	138,641,035.12	138,641,035.12
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)	2,916,943,158.31	414,637,476.18	3,331,580,634.49
其中: 1. 基金申购款	21,322,196,265.46	2,519,101,203.63	23,841,297,469.09
2. 基金赎回款	-18,405,253,107.15	-2,104,463,727.45	-20,509,716,834.60
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)	-	-3,261,759.93	-3,261,759.93

五、期末所有者权益(基金净值)	4,466,796,097.01	403,567,331.83	4,870,363,428.84
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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)	-	-59,474,056.82	-59,474,056.82
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)	1,526,648,146.05	-85,530,250.00	1,441,117,896.05
其中：1. 基金申购款	3,760,563,183.85	-144,281,963.51	3,616,281,220.34
2. 基金赎回款	-2,233,915,037.80	58,751,713.51	-2,175,163,324.29
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)	-	-1,182,598.74	-1,182,598.74
五、期末所有者权益(基金净值)	1,549,852,938.70	-146,449,419.54	1,403,403,519.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳 主管会计工作的负责人：王德英 会计机构负责人：成江

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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一致。

### 7.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。基金买卖黄金现货实盘合约的差价收入不予征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。基金买卖黄金现货实盘合约及黄金现货延期交收合约未发生实物交割的，免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖黄金现货实盘合约及黄金现货延期交收合约的差价收入、黄金租赁的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 7.4.3 关联方关系

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、基金场外份额注册登记机构、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、基金销售机构
中国长城资产管理公司	基金管理人的股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的股东
天津港(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司	基金管理人的子公司
博时黄金交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“黄金 ETF 联接”）	基金管理人管理的其他基金

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。

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,556,277.31	3,008,735.95
其中：支付销售机构的客户维护费	5,816.93	-

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。

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。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,711,255.46	601,747.32

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。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.4.4.2 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

博时黄金 ETF

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
黄金 ETF 联接	42,110,000.00	2.28%	-	-
招商证券	13,200,000.00	0.72%	-	-

注：持有份额以中登当日持有人数据为准。

#### 7.4.4.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31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	11,755,316.40	30,055.18	313,193.20	2,906.31

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。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.5 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 7.4.6 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年度，本基金申购基金份额的对价总额为1,779,626,284.17元（2015年度：629,705,774.67元），其中包括以黄金合约支付的申购款408,881,040.00元（2015年度：18,988,260.00元）和以现金支付的申购款1,370,745,244.17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 12 月 31 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 4,869,237,373.00 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,402,761,069.60 元，无第二层次和第三层次)。于 2016 年 12 月 31 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负债均属于第一层次(2015 年 12 月 31 日：同)。

(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 12 月 31 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 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	4,869,237,373.00	98.18
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	75,668,529.52	1.53
7	其他各项资产	14,501,205.40	0.29
8	合计	4,959,407,107.92	100.00

## 8.2 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。

## 8.3 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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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。

### 8.4.2 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。

### 8.4.3 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。

## 8.5 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。

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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

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	18,451,070.00	4,869,237,373.00	99.98

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	6,472,165.00
2	应收证券清算款	1,830.69
3	应收股利	-
4	应收利息	8,022,109.71
5	应收申购款	5,100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	14,501,205.40
---	----	---------------

#### 8.12.4 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债券。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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		博时黄金交易型开放式 指数证券投资基金联接 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	3,083	53,364.25	67,959,800	41.31%	54,952,177	33.40%	41,610,000.00	25.29%
博时黄金 ETF 场外 D 类	9,883	2,368.65	5,046,795.86	21.56%	18,362,568.16	78.44%	-	-
博时黄金 ETF 场外 I 类	1,944,292	852.84	-	-	1,658,168,570.18	100.00%	-	-
合计	1,957,258	943.21	73,006,595.86	3.95%	1,731,483,315.34	93.79%	41,610,000.00	2.25%

### 9.2 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	中信证券股份有限公司	21,457,476	13.04%
2	招商证券股份有限公司	13,200,000	8.02%
3	东方证券股份有限公司	4,806,509	2.92%
4	兴全睿众资产—上海银行—龙工(上海) 机械制造有限公司	4,003,900	2.43%
5	西南证券股份有限公司	3,500,000	2.13%
6	陆唯	2,266,300	1.38%
7	嘉实基金—浦发银行—齐鲁证券(上海) 资产管理有限公司	1,878,300	1.14%

8	上海均直资产管理有限公司—均直孔最长强私募证券投资基金	1,800,000	1.09%
9	于翔	1,614,700	0.98%
10	博时基金—光大银行—东方汇智资产管理有限公司	1,500,000	0.91%
博时黄金 ETF 联接基金		42,110,000.00	25.60%

注：上述前十名基金份额持有人为除博时黄金 ETF 联接基金之外的场内份额持有人。

### 9.3 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	532,415.02	2.27%
	博时黄金 ETF 场外 I 类	65,945.90	0.00%
	合计	598,360.92	0.03%

### 9.4 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	0~10
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：本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 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	642,600,000.00	72,511,121.15	8,105,502,279.90
减：本报告期基金总赎回份额	722,400,000.00	49,473,630.85	6,832,308,162.35
本报告期基金拆	-	-	-

分变动份额			
本报告期末基金份额总额	164,521,977.00	23,409,364.02	1,658,168,570.18

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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有限公司为本基金提供审计服务。本报告期内本基金应付审计费 100000 元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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。

#### 11.7.2 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  
二〇一七年三月二十七日