
博时黄金交易型开放式证券投资基金
2020 年第 4 季度报告
2020 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：二〇二一年一月二十二日

§1 重要提示

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，于 2021 年 1 月 20 日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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

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
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
报告期末基金份额总额	2,078,088,083.87 份
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	<p>本基金主要采取被动式管理策略。</p> <p>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%。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

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。		
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		
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	1,948,321,977.00 份	2,351,690.80 份	127,414,416.07 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日)		
	博时黄金 ETF	博时黄金 ETF 场外 D 类	博时黄金 ETF 场外 I 类
1. 本期已实现收益	-30,871,329.98	-38,859.08	-2,078,229.46
2. 本期利润	-262,758,713.56	-330,568.21	-18,032,987.37
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1352	-0.1356	-0.1367
4. 期末基金资产净值	7,458,543,137.27	9,142,651.15	486,465,310.46
5. 期末基金份额净值	3.8282	3.8877	3.8180

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。

所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 本报告期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	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
过去三个月	-3.36%	0.80%	-3.22%	0.80%	-0.14%	0.00%
过去六个月	-2.22%	1.06%	-1.95%	1.06%	-0.27%	0.00%
过去一年	13.76%	1.14%	14.44%	1.14%	-0.68%	0.00%
过去三年	40.34%	0.83%	42.86%	0.83%	-2.52%	0.00%

过去五年	72.15%	0.80%	75.00%	0.80%	-2.85%	0.00%
自基金合同生效起至今	50.32%	0.82%	50.00%	0.83%	0.32%	-0.01%

2. 博时黄金ETF场外D类:

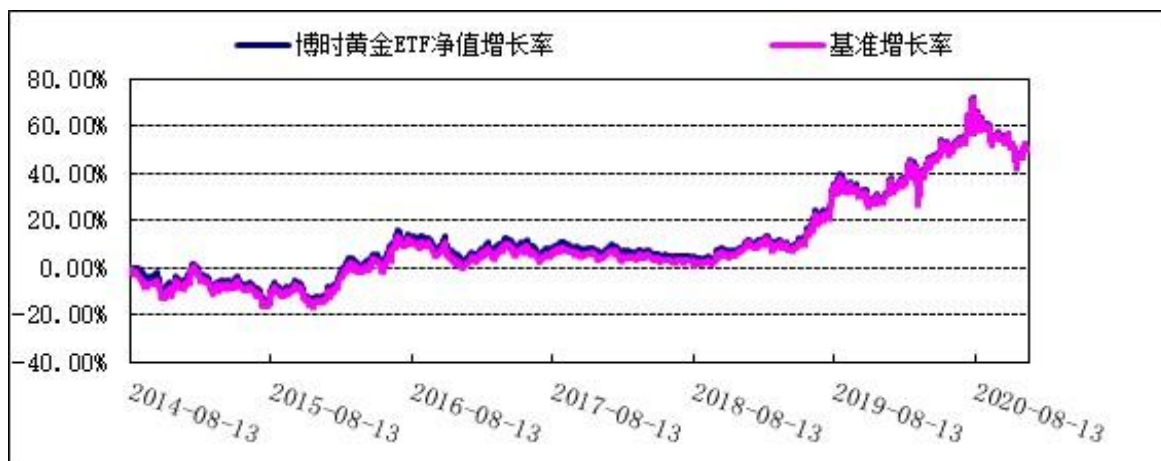
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.36%	0.80%	-3.22%	0.80%	-0.14%	0.00%
过去六个月	-2.21%	1.06%	-1.95%	1.06%	-0.26%	0.00%
过去一年	13.78%	1.14%	14.44%	1.14%	-0.66%	0.00%
过去三年	40.51%	0.83%	42.86%	0.83%	-2.35%	0.00%
过去五年	74.05%	0.80%	75.00%	0.80%	-0.95%	0.00%
自基金合同生效起至今	73.93%	0.82%	62.26%	0.81%	11.67%	0.01%

3. 博时黄金ETF场外I类:

阶段	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
过去三个月	-3.36%	0.80%	-3.22%	0.80%	-0.14%	0.00%
过去六个月	-2.22%	1.06%	-1.95%	1.06%	-0.27%	0.00%
过去一年	13.76%	1.14%	14.44%	1.14%	-0.68%	0.00%
过去三年	40.31%	0.83%	42.86%	0.83%	-2.55%	0.00%
过去五年	71.46%	0.80%	75.00%	0.80%	-3.54%	0.00%
自基金合同生效起至今	59.43%	0.81%	62.26%	0.81%	-2.83%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:



3. 博时黄金ETF场外I类:



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵云阳	指数与量化投资部投资副总监/基金经理	2015-10-08	-	10.4	赵云阳先生，硕士。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、量化分析师兼基金经理助理、博时特许价值混合型证券投资基金(2013 年 9 月 13 日-2015 年 2 月 9 日)、博时招财一号大数据保本混合型证券投资基金(2015 年 4 月 29 日-2016 年 5 月 30

				<p>日)、博时中证淘金大数据 100 指数型证券投资基金(2015 年 5 月 4 日-2016 年 5 月 30 日)、博时裕富沪深 300 指数证券投资基金(2015 年 5 月 5 日-2016 年 5 月 30 日)、上证企债 30 交易型开放式指数证券投资基金(2013 年 7 月 11 日-2018 年 1 月 26 日)、深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金(2012 年 11 月 13 日-2018 年 12 月 10 日)、博时深证基本面 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2012 年 11 月 13 日-2018 年 12 月 10 日)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018 年 12 月 10 日-2019 年 10 月 11 日)、博时创业板交易型开放式指数证券投资基金(2018 年 12 月 10 日-2019 年 10 月 11 日)、博时中证银行指数分级证券投资基金(2015 年 10 月 8 日-2020 年 8 月 5 日)、博时中证 800 证券保险指数分级证券投资基金(2015 年 5 月 19 日-2020 年 8 月 6 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资副总监兼博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时上证 50 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金联接基金(2016 年 5 月 27 日—至今)、博时中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金(2018 年 10 月 19 日—至今)、博时中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2018 年 11 月 14 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 9 月 20 日—至今)、博时中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2019</p>
--	--	--	--	--

					年 11 月 13 日—至今)、博时中证银行指数证券投资基金 (LOF) (2020 年 8 月 6 日—至今)、博时中证全指证券公司指数证券投资基金(2020 年 8 月 7 日—至今)的基金经理。
王祥	基金经理	2016-11-02	-	8.5	王祥先生, 学士。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。现任博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2016 年 11 月 2 日—至今)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2016 年 11 月 2 日—至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金(2016 年 11 月 2 日—至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金联接基金(2016 年 11 月 2 日—至今)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，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 9 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

充满波折与挑战的 2020 年终于成为历史，新的一年已经到来。由于欧美主流金融市场仍处于圣诞与元旦假期模式，黄金在相对淡静的交易中划上了年终的句号。国际金价在四季度呈现高位震荡，以消化年内高歌猛进后的浮躁动能，季度略微收涨 0.64%，国内人民币计价黄金在汇率走强的影响下冲淡了些许上涨的空间，季内收跌 3.22%。在四季度中，新冠疫苗的快速进展是引起市场风险偏好调整的重要原因，由于预期疫情在明年有望得到有效控制，部分避险资金撤离黄金资产，全球黄金 ETF 较峰值流出约 8%。而支持金价的最重要因素—实际利率的表现，季内经历了先升再降的过程，整体依然接近历史低位，伴随全球多轮货币与财政刺激政策，市场充裕的流动性环境仍是支持黄金慢牛的重要基石。

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，受租赁市场监管趋严、市场需求下降影响，黄金实物租赁业务运作比例较前期有所降低。

2020 年的最后一周里，美国总统特朗普最终签署了新一轮财政刺激法案，尽管其关于增加个人支票发放金额的提案目前较难在参议院获得通过，但来年伊始佐治亚州的决选很可能改变参议院的势力格局，对进一步的流动性预期仍存在边际上的增量预期。

另一方面，欧美当下的疫苗接种速度显著不及预期，美国迄今为止只接种了 430 万针疫苗，远低于在 2020 年底接种 2000 万的目标，欧洲的速度也同样缓慢。这在一定程度上也增加了市场的避险预期，从而推动黄金价格。不过，对于接种的缓慢一定程度上与联邦政府的态度有关，白宫的主要精力仍在于对大选结果的博弈，因此仅负责疫苗的到各个州的运输，后续的物流，分发和接种管理等流程由各州各县各自推动，缺乏统一指引。而特朗普关于新的财政法案的签署也较为迟缓，其中覆盖的关于疫苗分发和接种部分的资金尚未到账。由于拜登的权力交接很快来临，其更为坚决的防疫态度或在后续重新提振市场风险偏好，因此基于本项因素提振的黄金市场，其持续性需要进一步关注。

从历史的日历效应来看，1 月份是全年黄金市场中表现最好的时段，过往 10 年中仅有一年下跌，这在短期也有望提振黄金资产的资金偏好。不过，1 月的日历效应背后是传统实物消费旺季的推动。今年与以往相比，印度市场黄金溢价再度转为折价，标志着目前该国消费需求转衰，而另一大黄金消费国中国，考虑到当前疫情防控形势，元旦及春节的人员流动和消费情况很可能将继续受到负面影响，2021 年的春节需求或难以达到往年水平。

综合以上情况，在新年开市之后，近期压抑许久的国际黄金市场或在财政刺激、接种不及预期与日历效应的背景下展开一波攻势，但部分因素潜在反转可能，需警惕冲高回落的风险，预期整体一季度黄金市场依然多空较为均衡，整体维持中性判断。

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金场内类基金份额净值为 3.8282 元，份额累计净值为 1.5032 元，本基金 D 类场外类基金份额净值为 3.8877 元，份额累计净值为 1.6980 元，本基金 I 类场外类基金份额净值为 3.8180 元，份额累计净值为 1.5914 元，报告期内，本基金场内类基金份额净值增长率为-3.36%，本基金 D 类场外类基金份额净值增长率为-3.36%，本基金 I 类场外类基金份额净值增长率为-3.36%，同期业绩基准增长率为-3.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	7,914,761,370.00	99.45
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	38,613,714.09	0.49
8	其他资产	5,467,366.11	0.07
9	合计	7,958,842,450.20	100.00

5.2 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。

5.3 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。

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 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	AU9999	20,025,610.00	7,809,987,900.00	98.19
2	AU9995	AU9995	267,000.00	104,773,470.00	1.32

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 报告期内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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,000,236.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	1,467,130.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,467,366.11

5.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 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	1,918,921,977.00	2,476,554.53	135,718,648.72
报告期基金总申购份额	191,100,000.00	-	-
减：报告期基金总赎回份额	161,700,000.00	124,863.73	8,304,232.65
报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,948,321,977.00	2,351,690.80	127,414,416.07

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
博时黄金交易型开放式证券投资基金联接基金	1	2020-10-01~2020-12-31	1,786,597,900.00	45,000,000.00	18,000,000.00	1,813,597,900.00	87.27%

产品特有风险

本报告期内,本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况, 当该基金份额持有人选择大比例赎回时, 可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时, 存在一定的流动性风险; 为应对巨额赎回而进行投资标的变现时, 可能存在仓位调整困难, 甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理, 但当基金出现巨额赎回并被全部确认时, 申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险, 未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况, 根据基金合同相关约定, 该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会, 并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估, 充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下, 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时, 可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元, 基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外, 当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%时, 本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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 2020 年 12 月 31 日, 博时基金公司共管理 246 只公募基金, 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、职业年金及特定专户, 管理资产总规模逾 13294 亿元人民币, 剔除货币基金与短期理财债券基金后, 博时基金公募资产管理总规模逾 4012 亿元人民币, 累计分红逾 1373 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。

其他大事件

2020 年 12 月 31 日，在中国证券业协会主办，中国期货业协会、中国证券投资基金业协会协办的第七届证券期货科学技术奖中，博时基金、金证财富《新一代投资决策支持系统》荣获证券期货科学技术奖三等奖。

2020 年 12 月，大众证券报“2020 中国基金风云榜”揭晓，博时基金获“2020 年度十大风云基金公司”，博时医疗保健行业获“2020 年度十大风云基金产品”。

2020 年 12 月 23 日，在信息时报“金狮奖”中，博时基金荣获“年度最具核心竞争力基金公司”。

2020 年 12 月 15 日，“聚中国 投未来 2021 新财富资产管理年会”在深圳举办，博时基金荣获 2020 新财富最智慧投资机构。

2020 年 12 月 11 日，由证券时报 券商中国主办的“2020 中国金融科技先锋榜”隆重揭晓，博时基金荣登“中国公募基金智能投研先锋榜”。

2020 年 12 月 10 日，金融界“第五届智能金融国际论坛暨 2020 金融界领航中国年度盛典”，博时基金荣获四项大奖。博时基金董事长江向阳获“杰出年度基金领袖奖”，博时基金荣获“杰出年度创新基金公司奖”、“杰出年度基金公司奖”、“杰出年度海外投资基金公司奖”。

2020 年 12 月 10 日，香港中资基金业协会（HKCAMA）和彭博（Bloomberg）2020 年度“离岸中资基金大奖”中，博时国际荣膺“最佳跨境业务”大奖，“博时-东方红大中华债券基金”荣膺“最佳总回报-大中华区固定收益（1 年）”亚军。

2020 年 12 月 8 日，北京商报社主办的“数字金融 争渡未来 2020 年度北京金融论坛”在北京举办，博时基金荣获 2020 年度北京金融业十大品牌 产品创新卓越奖。

2020 年 12 月 2 日，经济观察报举办的 2020 卓越金融企业盛典举行，博时基金荣获“年度卓越综合实力基金公司”称号。

2020 年 11 月 28 日，由 21 世纪经济报道主办的第五届财经“金帆奖”评选中，博时基金荣获“2020 年度卓越基金管理公司”。

2020 年 11 月 27 日，国际金融报“第三届 CSR 先锋论坛暨 2020 先锋奖项颁奖典礼”在北京举办，凭借在社会责任方面的贡献，博时基金荣获 2020 年度社会责任先锋案例。

2020 年 11 月 20 日，2020 第一财经金融价值榜 颁奖典礼在上海举办，博时基金获选“2020 年度第一财经金融价值榜”年度基金公司管理人。

2020 年 11 月 19 日，由思维财经&投资者网主办的思维财经投资者年会暨“金桥奖”颁奖盛典上，博时基金荣获“金桥奖 年度最具投资价值基金公司”。

2020 年 11 月，联合国负责任投资原则组织(UN PRI)发布 2020 年度签署方评估报告。博时基金在衡量公司整体 ESG 管理水平的“战略与治理”模块，获得了首批最高评价“A+”评定。

2020 年 10 月 28 日，由《中国基金报》主办的“2020 中国机构投资者峰会”在上海浦东香格里拉酒店举行。第七届中国基金业英华奖中，博时基金陈凯杨荣获“五年期纯债投资最佳基金经理”，过均荣获“五年期二级债投资最佳基金经理”，何凯荣获“三年期海外固收投资最佳基金经理”及“五年期海外固收投资最佳基金经理”。第二届中国公募基金英华奖中，博时基金荣获“2019 年度最佳营销策划案例（最佳创意）”、“2019 年度最佳社会公益实践案例”、“2019 年度最佳电商业务发展基金公司”、“2019 年度最佳创新基金产品”、“2019 年度最佳营销策划案例（最佳综合）”、“2019 年度最佳指数增强基金”奖项。

2020 年 10 月 23 日，国际金融报主办的“2020 国际先锋金融机构高峰论坛暨颁奖典礼”在上海举办，博时基金董事长江向阳荣获“金融行业先锋领袖”、博时基金荣获“先锋证券投资机构”。

2020 年 10 月 16 日，由《每日经济新闻》主办的“2020 中国金融每经峰会资本市场高峰论坛暨 2020 中国金鼎奖颁奖典礼”在上海举行，博时基金成功斩获“固收+最具人气基金公司奖”和“最具影响力基金公司-专户一对多”奖项，博时基金投资经理王晓冬荣获“最具实力权益类专户基金经理”奖项。

2020 年 9 月 22 日，由《投资时报》及标点财经研究院联合主办的“见未来 2020 第三届资本市场高峰论坛暨金禧奖年度颁奖盛典”在京举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金荣获三项大奖。博时获评“金禧奖 2020 卓越公募基金公司”、“金禧奖 2020 优秀固收类基金团队”、“金禧奖 2020 大湾区特别贡献奖”。

2020 年 9 月 15 日，《上海证券报》第十七届“金基金”奖颁奖典礼在上海隆重举办，凭借综合资产管理能力和旗下产品业绩表现，博时基金及子公司博时资本共荣获三项大奖。博时基金荣获 2019 年度金基金·海外投资回报基金管理公司奖。博时旗下基金产品博时新起点灵活配置混合型证券投资基金获得 2019 年度金基金·灵活配置型基金三年期奖。博时资本张存相荣获“金阳光 三年卓越私募基金经理（MOM 类）”奖项。

2020 年 8 月 6 日，《经济观察报》“见圳四十年---深圳经济特区成立 40 周年特别盛典”在深圳举办，博时基金荣获“致敬深圳经济特区成立四十周年卓越企业”奖项。

2020 年 7 月 9 日，新浪财经“2020 中国基金业开放与发展高峰论坛暨基金业致敬资本市场 30 周年峰会”在云端举办，届时公布了 2020 中国基金业金麒麟奖，博时基金荣获“2020 十大风云基金公司”，此外，博时基金王俊荣获“2020 最受青睐股票基金经理”奖项，博时基金赵云阳、桂征辉、王祥均荣获“2020 最受青睐指数与 ETF 基金经理”奖项。

2020 年 6 月 29 日，《证券时报》第十五届中国基金业明星基金奖榜单公布，博时基金共荣获三项大奖，旗下产品博时外延增长主题混合与博时宏观回报债券分别拿下“三年持续回报平衡混合型明星基金”与“三年持续回报积极债券型明星基金”奖。博时信用债券基金摘得“十年持续回报债券型明星基金”奖。

2020 年 4 月 1 日，博时基金及子公司博时国际荣获《亚洲资产管理》2020“Best of the Best Awards”三项大奖。博时基金董事长兼总经理江向阳荣获“中国年度最佳 CEO”（Winner, China CEO of the Year-Jiang

Xiangyang), 博时基金(国际)有限公司荣获“香港最佳中资基金公司”(Winner, Hong Kong Best China Fund House), 博时信用债基金荣获“中国在岸人民币债券最佳业绩(5年)”(Winner, CNY Bonds, Onshore 5 Years-Bosera Credit Bond Fund)。

2020年3月31日,《中国证券报》第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓,博时基金旗下绩优产品博时信用债纯债债券荣获“七年期开放式债券型持续优胜金牛基金奖”。

2020年3月26日, Morningstar 晨星(中国)2020年度基金评选结果揭晓,博时信用债券在参选的同类428只基金中脱颖而出,摘得晨星“2020年度激进债券型基金奖”。

2020年1月10日,新京报“开放 普惠 科技”2019金融行业评选颁奖典礼在北京举办,博时基金凭借在可持续发展金融方面的努力成果,荣获“2019年度杰出社会责任影响力企业”。

2020年1月4日,2020《财经》可持续发展高峰论坛暨长青颁奖典礼在北京举办,博时基金凭借在ESG投资及可持续发展金融推动方面的耕耘和成果,荣获“2020《财经》长青奖-可持续发展创新奖”。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证监会批准博时黄金交易型开放式证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时黄金交易型开放式证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时黄金交易型开放式证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 9.1.5 博时黄金交易型开放式证券投资基金各年度审计报告正本
- 9.1.6 报告期内博时黄金交易型开放式证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通:95105568(免长途话费)

博时基金管理有限公司
二〇二一年一月二十二日