博时黄金交易型开放式证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

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:二〇一五年八月二十七日

§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2015年8月26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2015年1月1日起至6月30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	218,318,651.74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	1,621,977.00份	263,688.43份	216,432,986.31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	tcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105568	95566
传真		0755-83195140	010-66594855

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(2015年1月1日至2015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	-6,107.92	8,523.63	375,636.92
本期利润	46,576.06	150,619.61	-7,038,932.62
加权平均基金份额本期利润	0.0349	0.5939	-0.0719
本期基金份额净值增长率	-2.94%	4.76%	-2.30%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2015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	-1.9657	0.1243	-0.0545
期末基金资产净值	3,797,028.04	666,756.22	509,203,504.98
期末基金份额净值	2.3410	2.5286	2.3527

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	-1.13%	0.50%	-1.12%	0.50%	-0.01%	0.00%
过去三个月	-0.19%	0.71%	-0.26%	0.71%	0.07%	0.00%
过去六个月	-2.94%	0.82%	-2.35%	0.85%	-0.59%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-8.08%	0.89%	-9.64%	0.94%	1.56%	-0.05%

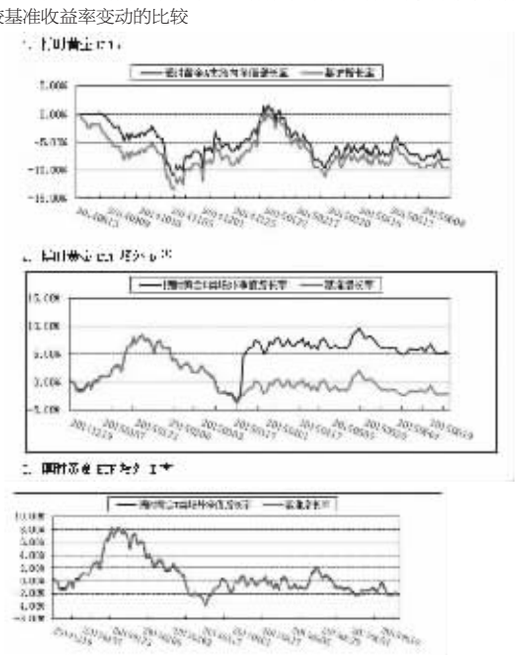
博时黄金ETF场外D类

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	-1.11%	0.50%	-1.12%	0.50%	0.01%	0.00%
过去三个月	-0.06%	0.71%	-0.26%	0.71%	0.20%	0.00%
过去六个月	4.76%	1.03%	-2.35%	0.85%	7.11%	0.18%
自基金合同生效起至今	5.04%	1.01%	-2.25%	0.84%	7.29%	0.17%

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	-1.13%	0.50%	-1.12%	0.50%	-0.01%	0.00%
过去三个月	-0.20%	0.71%	-0.26%	0.71%	0.06%	0.00%
过去六个月	-2.30%	0.83%	-2.35%	0.85%	0.05%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-2.10%	0.82%	-2.25%	0.84%	0.15%	-0.02%

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



注:本基金的基金合同于2014年8月13日生效。按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十五条"(二)投资范围"、"(七)投资禁止行为与限制"的有关约定。本报告期末本基金建仓期尚未结束。

§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2015年6月30日,博时基金公司共管理七十只开放式基金,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。博时基金资产管理净值总规模逾3027.86亿元人民币, 其中公募基金资产规模逾1317.35亿元人民币,累计分红超过664.83亿元人民币,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,标准股票型基金中,截至6月30日,博时创业成长股票基金及博时卓越品牌股票基金今年以来净值增长率在379只标准型股票基金中分别排名前1/3和前1/2; 博时深证基本面200ETF及联接基金今年以来的净值增长率在175只指数股票型基金-标准指数股票基金及46只ETF联接基金中分别排名前1/2和前1/3;混合基金-偏股型基金中,博时精选股票基金今年以来的收益率在同类型36只产品中排名前1/3; 混合基金-灵活配置型基金中,博时裕隆灵活配置混合及博时裕益灵活配置混合基金今年以来的净值增长率在126只同类型基金中分别排名前1/3和前1/2。

固定收益方面,博时安丰18个月定期开放债券基金、博时优势收益信用债券、博时信用债纯债券今年以来收益率在71只同类长期标准债券型基金中分别排名前1/10、前1/2和前1/2;博时上证企债30ETF今年以来的收益率在18只指数债券型基金-指数债券型基金(A类)排名前1/3。

2、其他大事件

2015年1月7日, 博时基金在2014年信息时报金狮奖—金融行业风云榜的评选中获得年度最佳基金公司大奖。

2015年1月15日,在和讯网主办的第十二届中国财经风云榜评选中,博时基金获评第十二届中国财经风云榜"年度十大品牌基金公司"奖。

2015年1月18日,博时基金(香港)在和讯财经风云榜海外评选中荣获"最佳中资基金公司"奖。

2015年1月21日,在《华夏时报》第八届投资者年会暨金蝉奖评选中,博时转债增强荣获第八届金蝉奖"2014最佳年度债基品牌奖"。

2015年3月28日, 在第十二届中国基金业金牛奖评选中, 博时主题行业(LOF)基金、博时信用债券基金分别获得 "2014年度开放式股票型金牛基金"奖、"三年期开放式债券型持续优胜金牛基金"奖。

2015年3月28日,在中金在线主办的"2014年度财经排行榜"评选中,邓欣雨获评"2014年度中金在线财经排行榜最佳基金经理"。

2015年4月22日,由上海证券报社主办的第十二届中国"金基金"奖的评选揭晓,博时主题行业股票证券投资基金(LOF)获得5年期股票型金基金奖。

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		
方惟玲	指数投资部副总经理/基金经理	2014/8/13	-	23.5	1992年起先后在云南大学、海南省信托投资公司、湘财证券、北京农方量子公司工作,2001年加入博时基金管理有限公司,历任金融工程师、数量化投资部副总经理、产品规划部总经理、投资经理、基金经理助理。现任指数投资部副总经理兼博时上证超大盘ETF基金、博时上证超大盘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、博时黄金ETF基金、博时标普500ETF基金、博时标普500ETF联接(QDII)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、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2015年上半年,黄金价格一季度冲高回落后,二季度在相对较窄的震荡区域内波动。年初在全球频发诸如瑞郎事件、欧盟等各大央行的新一轮宽松等,使黄金年初一度成为除美元之外的避险品种,价格不断上涨,期间最高达1302美元/盎司,为2014年9月以来的高位;随后,受美国经济数据持续转好、以及美联储加息预期,亚洲实物需求不旺等因素影响,黄金逐步走弱,期间由于美联储加息延后、希腊危机、欧元区经济因宽松货币政策迎来反弹等因素,因阶段性利好金价使其在成本区域获得支撑,因此金价二季度在一个窄幅的区间内波动。

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。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,A类场内份额净值为2.3410元, 份额累计净值为0.9192元,报告期内净值增长率为-2.94%,同期业绩基准涨幅为-2.35%。I类场外份额净值为2.3527元,份额累计净值为0.9791元,报告期内净值增长率为-2.30%,同期业绩基准涨幅为-2.35%。D类场外份额净值为2.5286元,份额累计净值为1.0504元,报告期内净值增长率为4.76%,同期业绩基准涨幅为-2.35%。

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,我们认为黄金价格将触及历史性阶段底部。因美国经济持续复苏,美联储年内加息是大概率事件,这之前将对黄金价格一直产生压制,会使黄金价格不断逼近甚至低于成本区域,这为有长期配置黄金资产需求的投资者提供了很好的机会。同时美国经济数据可能的反复、或美联储加息落地、以及全球宽松货币政策对黄金价格的支撑、其他地域政治风险因素等,都会使黄金价格出现触底反弹的可能,这也将为投资者提供较多的交易型机会。

在投资策略上,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。我们希望通过博时黄金ETF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I类本报告期内向份额持有人分配利润530,542.82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:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	686,988.52	121,038.64
结算备付金	5,247,688.39	564,156.25
存出保证金	213,977.40	-
交易性金融资产	520,765,654.60	23,563,780.00
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	520,765,654.60	23,563,780.00
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	626.22	-
应收利息	710,454.67	4,937.54
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	527,625,389.80	24,253,912.43
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	721,770.00
衍生金融负债	626.22	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	1,808.76
应付赎回款	13,531,768.71	532,206.60
应付管理人报酬	182,170.98	4,760.89
应付托管费	36,434.15	952.19
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	207,100.50	50,136.32
负债合计	13,958,100.56	1,311,633.76
所有者权益:	-	-
实收基金	525,771,524.16	23,204,792.65
未分配利润	-12,104,234.92	-262,513.98
所有者权益合计	513,667,289.24	22,942,278.67
负债和所有者权益总计	527,625,389.80	24,253,912.43

注:本基金合同生效日为2014年8月13日。报告截止日2015年06月30日,基金场内份额净值2.3410元,D类场外份额净值为2.5286元,I类场外份额净值为2.3527元。基金份额总额218,318,651.74份,其中,场内份额为1,621,977.00份,D类场外份额为263,688.43份,I类场外份额为216,432,986.31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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入	-5,211,062.33
1.利息收入	2,140,832.07
其中:存款利息收入	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	-
其他利息收入	2,125,145.97
2.投资收益(损失以"-"填列)	-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	26,746.46
衍生工具收益	-184,898.78
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-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)	26,047.50
减:二、费用	1,630,674.62
1. 管理人报酬	578,629.71
2. 托管费	115,725.84
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	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	237,419.63
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-6,841,736.95
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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	-2,882,472.46	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》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。

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 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	578,629.71
其中:支付销售机构的客户维护费	-

注:本基金合同于2014年8月13日生效。

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。

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 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	115,725.84

注:本基金合同于2014年8月13日生效。

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 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	686,988.52	840.68

注:本基金合同于2014年8月13日生效。

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(2015年06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。

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。

§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	520,765,654.60	98.70
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	5,934,676.91	1.12
7	其他各项资产	925,058.29	0.18
8	合计	527,625,389.80	100.00

7.2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。

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末基金资产净值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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3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。

7.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7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	Au9999	2,216,590	520,765,654.60	101.38

7.9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。

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	213,977.40
2	应收证券清算款	626.22
3	应收股利	-
4	应收利息	710,454.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	925,058.29

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	
			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	406	3,995.02	220,000.00	13.56%	1,401,977.00	86.44%
博时黄金ETF场外D类	50	5,273.77	-	-	263,688.43	100.00%
博时黄金ETF场外I类	119,811	1,806.45	-	-	216,432,986.31	100.00%
合计	120,267	1,815.28	220,000.00	0.10%	218,098,651.74	99.90%

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	山东省企业托管经营股份有限公司	220,000	13.56%
2	徐振伟	145,100	8.95%
3	徐晨嘉	87,500	5.39%
4	吴维一	55,284	3.41%
5	张珊珊	52,214	3.22%
5	王成华	46,068	2.84%
7	张萍	45,900	2.83%
8	廖干红	23,800	1.47%
9	包海	21,036	1.30%
10	穆峰	20,000	1.23%

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	3,237.16	1.23%
	博时黄金ETF场外I类	35,827.63	0.02%
	合计	39,064.79	0.02%

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	-
	博时黄金ETF场外I类	-
	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	2,221,977.00	7,855.00	7,280,672.71
本报告期基金总申购份额	2,400,000.00	9,124,366.77	562,621,096.95
减:本报告期基金总赎回份额	3,000,000.00	8,868,533.34	353,468,783.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,621,977.00	263,688.43	216,432,986.31

§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

1、基金管理人于2015年4月13日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》, 吴姚东不再担任博时基金管理有限公司总经理职务,由王德英代任总经理职务。2、基金管理人于2015年6月20日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,徐卫担任博时基金管理有限公司副总经理职务。3、基金管理人于2015年7月10日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,江向阳担任博时基金管理有限公司总经理职务。4、基金管理人于2015年8月8日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,张光华任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人,洪小源不再任博时基金管理有限公司董事长暨法定代表人。

2015年4月,李爱华先生不再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。

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

2015年2月,我司收到《深圳证监局关于对博时基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,要求公司对后台权限设置等问题进行改正,我司立即进行了改正并已经完成了验收。

除上述情况外,本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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

二〇一五年八月二十七日