

博时黄金交易型开放式证券投资基金

[2014] 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:2015年3月28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、完整性承担责任。本基金报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并经托管人复核。

博时基金管理有限公司根据本基金合同规定，于2014年3月27日复核了本报告中的财务数据、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，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告摘要摘录了年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

根据基金管理人2014年12月15日发布的《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场外份额和场内份额变更的公告》，自2014年12月18日起对本基金实施场外份额。具体内容请查阅指定报刊上的各项相关公告。

§ 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
基金代码	15937
交易代码	15937
基金运作方式	交易型开放式基金
基金合同生效日	2014年1月13日
基金存续期间	2014年1月13日至2014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
报告期末基金份额总额	9,510,504.71份
基金资产净值	人民币9,510,504.71元
基金份额净值	人民币0.9999元/份
基金总资产	深证证券交易所
基金总负债	深证证券交易所
报告期末持有的现金及现金等价物余额	博时黄金ETF场外类
下一级分类基金的交易代码	15937 0.00929 0.00930
报告期末下属分级基金的份额	2,221,977.00份 7,855.00份 7,280,672.71份

2.2 基金产品说明

本基金通过投资于黄金交易所的黄金现货合约，在扣除年度度和跟踪误差最小化的情况下获取收益。力争在扣除年度度和跟踪误差最小化的情况下获取收益。力争在扣除年度度和跟踪误差最小化的情况下获取收益。

本基金主要投资于黄金现货合约，跟踪误差、流动性风险和交易便利程度的考虑，黄金现货合约占基金资产比例不超过95%。

业绩比较基准 黄金现货合约 AL199.99 元/克

风险收益特征 本基金主要投资于黄金现货合约，风险敞口/收益水平与黄金相似，在证券投资基金中属于风险较高且预期收益较高的品种。

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
姓名	余鹏清	王永民
信息披露负责人	0755-83169999	010-66594896
联系电话	service@bj009.com	Feidu@bankofchina.com
电子邮箱		
客户服务电话	95105568	95566
传真	0755-83195140	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 <http://www.bn009.com>

基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标			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场外类	博时黄金ETF场内类			
本期已实现收益	-3,362.58	27.34	13,922.85		
本期利润	216,427.78	68.49	121,859.24		
加权平均基金份额本期利润	0.0055	0.0002	0.0056		
本期基金份额净值增长率为	-5.30%	0.26%	0.21%		

2014年末

3.1.2 到期数据和指标			2014年末		
博时黄金ETF	博时黄金ETF场外类	博时黄金ETF场内类			
基金份额可供分配利润	-0.1349	0.0040	0.0026		
基金份额净值	5,359,251.12	18,950.04	17,564,068.51		
基金份额累计净值	2,011.00	2,415.00	2,424.00		

注:本基金合同于2014年8月13日成立,基金合同生效日起未满一年。

本期已实现收益指基金本期利息收入,按公允价值计算;其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

本期利润指基金本期利息收入,按公允价值计算的收益减去公允价值变动收益后的余额。

本期基金份额净值增长率为扣除红利后的净值变动。

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。

自2014年12月1日起对本基金增设场外类份额,同时,本基金场外份额净值更为本基金的D类场外份额。本基金场外份额根据费用收取方式分为场内类份额和场外类份额,D类场外份额和场外场内份额单独设置基金代码,并公布基金份额净值。

3.2 基金份额表现

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	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-1.10%	1.16%	-0.27%	1.21%	-1.04%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	-5.30%	0.98%	-7.47%	1.04%	2.17%	-0.06%
成立以来	0.26%	0.67%	0.10%	0.86%	0.16%	-0.19%

2.博时黄金ETF场外D类:

阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	0.26%	0.67%	0.10%	0.86%	0.16%	-0.19%
自基金合同生效日起至今	-5.30%	0.98%	-7.47%	1.04%	2.17%	-0.06%

3.博时黄金ETF场外类:

阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	0.26%	0.67%	0.10%	0.86%	0.16%	-0.19%
自基金合同生效日起至今	-5.30%	0.98%	-7.47%	1.04%	2.17%	-0.06%

注:自2014年12月18日起对本基金增设场外类份额,同时,本基金场外份额净值更为本基金的D类场外份额。本基金的场外份额根据费用收取方式分为场内类份额和场外类份额,D类场外份额和场外场内份额单独设置基金代码,并公布基金份额净值。

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

1.博时黄金ETF:

阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-1.10%	1.16%	-0.27%	1.21%	-1.04%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	-5.30%	0.98%	-7.47%	1.04%	2.17%	-0.06%

2.博时黄金ETF场外D类:

阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-1.10%	1.16%	-0.27%	1.21%	-1.04%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	-5.30%	0.98%	-7.47%	1.04%	2.17%	-0.06%

3.博时黄金ETF场外类:

阶段	净值增长率为①	净值增长率为②	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-1.10%	1.16%	-0.27%	1.21%	-1.04%	-0.05%
自基金合同生效日起至今	-5.30%	0.98%	-7.47%	1.04%	2.17%	-0.06%

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,不按整个自然年进行折算。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

4.1 基金管理人及基金经理的情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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