

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:二〇一八年一月二十日

§ 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，并对内容的真实性、准确性承担个别及连带责任。

基金管理人的高级管理人员及基金经理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，并对内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

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基金的招募说明书。

本报告期截至2017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

基金代码:160937

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1月13日

报告期末基金份额总额:2,767,165,725.87份

投资目标:本基金通过投资于黄金交易所交易的黄金现货合约，在跟踪标的指数和跟踪误差

最小的情况下，力争为投资者提供与标的指数表现接近的回报。

投资策略:本基金主要通过投资于黄金现货合约，主动投资于黄金期货、黄金现货合约、黄金衍生品等金融产品，以实现对标的指数的跟踪。

业绩比较基准:黄金现货合约价格×90%+人民币银行存款利率(税后)×10%

风险收益特征:本基金主要投资于黄金现货合约，预期风险/收益水平与黄金相拟。

基金管理人:中国银行股份有限公司

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场外类

博时黄金ETF场外类

下属分级基金的交易代码:159937

000929

000930

报告期末下属分级基金:187,621,977.00份

34,934,403.75份

2,453,699,345.32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

报告期:2017年10月1日-2017年12月31日

主要财务指标

博时黄金ETF

博时黄金ETF场外类

博时黄金ETF场外类

1.本期已实现收益

-66,124.69

7,963.67

-601,913.68

5,494,832.68

2.本期利润

-7,110,550.40

-891,011.02

-24,694,832.68

3.加权平均基金份额利润

-0.0421

-0.0326

-0.0138

4.期末基金资产净值

511,815,030.96

96,656,569.07

6,676,506,236.54

5.期末基金份额总额

2,727.00

2,768.00

2,721.00

注:本基金为实现收益基金本期利息收入、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,本期利润为本报告期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,计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金主要指标

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:过去三月

净值增长率(%)

-1.73%

业绩比较基准收益率(%)

0.34%

-1.60%

0.35%

-0.12%

-0.01%

2.博时黄金ETF场外类

阶段:过去三月

净值增长率(%)

-1.66%

业绩比较基准收益率(%)

0.34%

-1.60%

0.35%

-0.06%

-0.01%

3.博时黄金ETF场外类

阶段:过去三月

净值增长率(%)

-1.66%

业绩比较基准收益率(%)

0.34%

-1.60%

0.35%

-0.06%

-0.01%

注:上表在本报告期,离任日期前的基本基金管理人、代理人根据约定的任免日期填写。

本基金的管理人从2017年10月1日起至12月31日止。

3.3 基本产品概况

在本报告期内,本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金评价办法》、《公开募集证券投资基金信息披露费率管理规定》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等法律法规的规定,并勤勉尽责地履行基金管理人的职责,在本报告期内,本基金管理人严格按照法律法规的规定,履行了信息披露、报告、基金资产估值、投资管理、净值计算、利润分配、申购赎回、基金转换、基金扩募与基金终止等各项基金业务,确保了本基金的规范运作。

在本报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金评价办法》、《公开募集证券投资基金信息披露费率管理规定》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》等法律法规的规定,履行了信息披露、报告、基金资产估值、投资管理、净值计算、利润分配、申购赎回、基金转换、基金扩募与基金终止等各项基金业务,确保了本基金的规范运作。

在本报告期内,本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金评价办法》、《公开募集证券投资基金信息披露费率管理规定》、《公开募集开放式证券