

博时黄金交易型开放式证券投资基金  
2018 年半年度报告摘要  
2018 年 6 月 30 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：二〇一八年八月二十九日

## § 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 2018 年 8 月 28 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 2018 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      | 3,841,394,410.08 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 | 3,057,121,977.00 份 | 13,227,561.10 份 | 771,044,871.98 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                |
|         | 联系电话          | 0755-83169999      |
|         | 电子邮箱          | service@bosera.com |
| 客户服务电话  | 95105568      | 95566              |
| 传真      | 0755-83195140 | 010-66594942       |

### 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半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（2018年1月1日至2018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       | 5,733,652.58              | 730,707.66     | 40,780,465.55    |
| 本期利润          | -52,409,927.40            | -652,888.56    | -13,866,663.02   |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0324                   | -0.0340        | -0.0132          |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.32%                    | -2.26%         | -2.32%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018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  | -3.2754                   | 0.3000         | 0.2509           |
| 期末基金资产净值      | 8,146,312,765.67          | 35,769,408.63  | 2,049,471,761.66 |
| 期末基金份额净值      | 2.6647                    | 2.7042         | 2.6580           |

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      | -0.86%   | 0.24%       | -0.80%     | 0.24%         | -0.06% | 0.00%  |
| 过去三个月      | -1.33%   | 0.32%       | -1.18%     | 0.31%         | -0.15% | 0.01%  |
| 过去六个月      | -2.32%   | 0.40%       | -2.06%     | 0.40%         | -0.26% | 0.00%  |
| 过去一年       | -2.55%   | 0.43%       | -2.09%     | 0.43%         | -0.46% | 0.00%  |
| 过去三年       | 13.83%   | 0.73%       | 13.81%     | 0.73%         | 0.02%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 4.63%    | 0.77%       | 2.84%      | 0.78%         | 1.79%  | -0.01% |

###### 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 | -0.86%   | 0.24%       | -0.80%     | 0.24%         | -0.06% | 0.00% |
| 过去三个月 | -1.31%   | 0.32%       | -1.18%     | 0.31%         | -0.13% | 0.01% |
| 过去六个月 | -2.26%   | 0.40%       | -2.06%     | 0.40%         | -0.20% | 0.00% |

|            |        |       |        |       |       |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去一年       | -1.95% | 0.43% | -2.09% | 0.43% | 0.14% | 0.00% |
| 过去三年       | 15.18% | 0.73% | 13.81% | 0.73% | 1.37% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.98% | 0.78% | 11.25% | 0.75% | 9.73% | 0.03% |

**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      | -0.86%   | 0.24%       | -0.80%     | 0.24%         | -0.06% | 0.00%  |
| 过去三个月      | -1.33%   | 0.32%       | -1.18%     | 0.31%         | -0.15% | 0.01%  |
| 过去六个月      | -2.32%   | 0.40%       | -2.06%     | 0.40%         | -0.26% | 0.00%  |
| 过去一年       | -2.57%   | 0.43%       | -2.09%     | 0.43%         | -0.48% | 0.00%  |
| 过去三年       | 13.37%   | 0.73%       | 13.81%     | 0.73%         | -0.44% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 10.99%   | 0.74%       | 11.25%     | 0.75%         | -0.26% | -0.01% |

注：本基金的业绩比较基准为：黄金现货实盘合约 AU99.99 收益率。

**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 ETF**



**博时黄金 ETF 场外 D 类**



**博时黄金ETF场外I类:**



## § 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 2018 年 06 月 30 日，博时基金公司共管理 185 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 8461 亿元人民币，其中非货币公募基金规模逾 1947 亿元人民币，累计分红逾 872 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行业中名列前茅。

#### 1、基金业绩

根据银河证券基金研究中心统计，截至 2018 年 2 季末：

权益基金方面，标准指数股票型基金里，博时中证银联智惠大数据 100 指数(A 类)、博时裕富沪深 300 指数(A 类)等今年以来净值增长率同类排名为前 1/4；股票型分级子基金里，博时中证银行分级指数(B 级)等今年以来净值增长同类基金中排名为前 1/3；混合偏股型基金中，博时创业成长混合(C 类)今年以来净值增长率同类基金排名第一，博时创业成长混合(A 类)今年以来净值增长率同类基金排名位居前 1/10，博时行业轮动混合等今年以来净值增长率同类排名为前 1/3；混合灵活配置型基金中，博时裕益灵活配置混合基金今年以来净值增长率为 3.14%，在 166 只同类基金排名第 6，博时汇智回报灵活配置混合基金今年以来净值增长率为 4.38%，同类基金排名位居前 1/10，博时新价值灵活配置混合(A 类)、博时新策略灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(A 类)、博时新起点灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率分别为 2.12%、1.93%、1.65%、1.60%，同类基金排名均位居前 1/8，博时新价值灵活配置混合(C 类)今年以来净值增长率为 2.07%，同类基金中排名位于前 1/6。

黄金基金类，博时黄金 ETF 联接(A 类)、博时黄金 ETF 联接(C 类)今年以来净值增长率同类排



名第一。

固收方面，长期标准债券型基金中，博时天颐债券(A类)、博时宏观回报债券(A/B类)、博时信用债券(A/B类)今年以来净值增长率为5.11%、4.56%、4.54%，同类219只基金中分别排名第3、第8、第9位，博时天颐债券(C类)、博时信用债券(R类)、博时信用债券(C类)、博时宏观回报债券(C类)今年以来净值增长率分别为4.88%、4.56%、4.34%、4.23%，同类153只基金中分别排名第2、第4、第7、第8位，博时富华纯债债券、博时景兴纯债债券、博时富益纯债债券、博时裕康纯债债券、博时富发纯债债券、博时聚瑞纯债债券等今年以来净值增长率分别为4.43%、4.10%、3.98%、3.93%、3.89%、3.88%，同类排名前1/10；货币基金类，博时兴荣货币、博时合惠货币(A类)今年以来净值增长率分别为2.21%、2.18%，在315只同类基金排名中位列第15位与第24位。

QDII基金方面，博时标普500ETF(QDII)、博时标普500ETF联接(QDII)(A类)，今年以来净值增长率同类排名分别位于前1/5、1/4。

## 2、其他大事件

2018年6月8日，由《中国证券报》主办的中国基金业二十周年高峰论坛暨第十五届“中国基金业金牛奖”颁奖典礼在苏州隆重举行。经过激烈且公平的票选，博时基金获得“2017年度最受信赖金牛基金公司”荣誉称号。

2018年5月24日，由《中国基金报》、《证券时报》主办的“第五届中国基金业英华奖、中国基金业20年最佳基金经理评选颁奖典礼暨高峰论坛”在深圳隆重举行。从业经历逾23年的博时基金副总经理兼高级投资经理董良泓荣获“中国基金业20年最佳基金经理”殊荣，此荣誉于全行业仅有20人获评；博时基金固收名将陈凯杨则凭借长期稳健的投资业绩荣膺“三年期纯债投资最佳基金经理”称号。值得一提的是，这也是陈凯杨继2016年之后连续两年蝉联该项殊荣，足见市场对其管理业绩的认可。

2018年5月23日，由新浪财经和济安金信主办的“致敬公募20年”颁奖典礼在北京举行，公募基金老五家之一的博时基金凭借长期优良的投研业绩、雄厚的综合资管实力和对价值投资理念的一贯倡导共揽获“最佳资产管理公司”、“最受投资者欢迎基金公司”、“行业特别贡献奖”和“区域影响力奖-珠三角”这四项最具份量的公司大奖；博时基金总经理江向阳获得“行业领军人物奖”。同时，博时旗下产品博时双月薪定期支付债券基金(000277)获得“最具价值理念基金产品奖-债券型”，博时亚洲票息收益债券(QDII)(人民币050030：，美元现汇：050202，美元现钞：050203)获得“最具投资价值基金产品奖-QDII”。

2018年5月17日，被誉为“证券期货行业科学技术领域最高荣誉”的第六届证券期货科学技术奖的评审结果近日在北京揭晓。博时基金从上百个竞争对手中脱颖而出，一举夺得二等奖(DevOps统一研发平台)、三等奖(证券投资基金行业核心业务软件系统统一测试)以及优秀奖(新一代基金理财综合业务接入平台)三项大奖，成为获得奖项最多的金融机构之一。

2018年5月10日，由《上海证券报》主办的“2018中国基金业峰会暨第十五届金基金奖颁奖

典礼”在上海举行。在此次颁奖典礼上，博时基金揽获“金基金 TOP 基金公司”这一最具份量的公司大奖；博时基金权益投资总部董事总经理兼股票投资部总经理李权胜获评“金基金最佳投资回报基金经理奖”。在第 15 届金基金奖评选中，旗下价值投资典范产品博时主题行业（160505）获得“三年期金基金分红奖”。

2018 年 3 月 26 日，第十五届中国基金业金牛奖评奖结果也拉开帷幕。公募“老五家”之一的博时基金凭借长期出色的投资业绩、锐意进取的创新姿态和对价值投资的坚守一举夺得全场份量最重的“中国基金业 20 年卓越贡献公司”大奖。同时，旗下绩优产品博时主题行业混合（LOF）（160505）荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”奖；博时信用债纯债债券（050027）荣获“三年期开放式债券型持续优胜金牛基金”奖。

2018 年 3 月 22 日，由中国基金报、香山财富论坛主办的“第五届中国机构投资者峰会暨中国基金业英华奖公募基金 20 周年特别评选、中国基金业明星基金奖颁奖典礼”在北京举办，本次评选中，博时基金一举斩获本届“20 周年特别评选”中最具分量的两项公司级大奖——公募基金 20 年“十大最佳基金管理人”奖和“最佳固定收益基金管理人”奖，同时，旗下明星基金博时主题行业、博时信用债券分别将“最佳回报混合型基金”奖和“最佳回报债券型基金（二级债）”奖双双收入囊中，博时聚润纯债债券则获得“2017 年度普通债券型明星基金”奖。

2018 年 2 月 2 日，由金融界举办“第二届智能金融国际论坛”暨第六届金融界“领航中国”年度盛典在南京举办，此次论坛以“安全与创新”为主题，邀请业内专家学者就现阶段行业发展的热点问题深入探讨。博时基金凭借优异的业绩与卓越的品牌影响力斩获“五年期投资回报基金管理公司奖”和“杰出品牌影响力奖”两项大奖。

2018 年 1 月 11 日，由中国基金报主办的“中国基金产品创新高峰论坛暨中国基金业 20 年最佳创新产品奖颁奖典礼”在上海举办。博时基金一举摘得“十大产品创新基金公司奖”，旗下产品博时主题行业混合基金（160505）和博时黄金 ETF 分别获得“最佳主动权益创新产品奖”和“最佳互联网创新产品奖”，成为当天最大赢家之一。

2018 年 1 月 9 日，由信息时报主办的“第六届信息时报金狮奖——2017 年度金融行业风云榜颁奖典礼”在广州隆重举行。博时基金凭借优秀的基金业绩和广泛的社会影响力荣获“年度最具影响力基金公司”大奖。

#### 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      | -    | 7.8    | 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（2013.9.13-2015.2.9）、博时招财一号保本基金 |



|    |      |            |   |   |   |
|----|------|------------|---|---|---|
|    |      |            |   |   | (2015. 4. 29-2016. 5. 30)、博时中证淘金大数据 100 基金 (2015. 5. 4-2016. 5. 30)、博时沪深 300 指数基金 (2015. 5. 5-2016. 5. 30)、上证企债 30ETF 基金 (2013. 7. 11-2018. 1. 26) 基金经理。现任博时深证基本面 200ETF 基金 (2012. 11. 13-至今) 兼博时深证基本面 200ETF 联接基金 (2012. 11. 13-至今)、博时证券保险指数分级基金 (2015. 5. 19-至今)、博时黄金 ETF 基金 (2015. 10. 8-至今)、博时上证 50ETF 基金 (2015. 10. 8-至今)、博时上证 50ETF 联接基金 (2015. 10. 8-至今)、博时银行分级基金 (2015. 10. 8-至今)、博时黄金 ETF 联接基金 (2016. 5. 27-至今) 的基金经理。 |
| 王祥 | 基金经理 | 2016-11-02 | - | 6 | 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 (2016. 11. 2-至今) 兼博时黄金 ETF 联接基金 (2016. 11. 2-至今)、博时上证自然资源 ETF 基金 (2016. 11. 2-至今)、博时上证自然资源 ETF 联接基金 (2016. 11. 2-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

2018 年上半年，对于黄金市场而言，尽管地缘政治事件频发，各经济体金融政策的协调性与稳定性也均有所下降，但美联储坚定升息的步伐与美元依然强劲的表现对冲了大部分的黄金需求。国际金价冲高回落，半年整体收跌-3.86%。强劲美元的原生逻辑在于美国经济复苏格局进一步确立，与其他经济体的强弱分化有所拉开，处于独树一帜的状态。叠加特朗普团队执政行动力与稳定性均趋于上升，全球资本转向流入美国。以其计价的大宗商品受到压制，黄金自然也难以独善其身。同时，伴随着美国通胀指针的走强，美联储的加息路径愈发清晰与稳定，这都给国际黄金带来了不小的压力。

与此对应的是人民币计价的国内黄金市场，一方面境内黄金市场年化波动率降低至仅 6%左右的水平，投资者参与热情有所涣散。另一方面，黄金成为交易人民币汇率的有效介质，强弱表现已为境内外套利盘所主导。

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。出于对整体流动性管理更加严格的风控要求，本年度黄金租赁业务比例有所下降。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 06 月 30 日，本基金 A 类场内类基金份额净值为 2.6647 元，份额累计净值为 1.0463 元，本基金 I 类场外类基金份额净值为 2.6580 元，份额累计净值为 1.1095 元，本基金 D 类场外类基金份额净值为 2.7042 元，份额累计净值为 1.2064 元。报告期内，本基金 A 类场内基金份额净值增长率为-2.32%，本基金 I 类场外基金份额净值增长率为-2.32%，本基金 D 类场外基金份额净值增长率为-2.26%，同期业绩基准增长率-2.06%。

### 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 2018 年下半年，汇率对黄金的影响料持续存在，境内黄金市场或迎来涅槃重生的机会。

6 月中旬以来的人民币本波贬值论持续性与独立性都是较为凸出的，黄金由于其硬通货的特性，容易成为交易人民币汇率的有效介质。结合近期黄金市场对裹足不前的美国国债收益率以及不达预期的美国 GDP 数据等反应有限，以及 CFTC 持仓中反常的出现基金管理净多头接近 0 值，我们有理由推测在通胀指标提升的背景下做空金银比价的套利空，与交易人民币的境内外黄金套利空或许已经成为把控近期黄金市场的主要力量。随着中美贸易争端趋于深入，人民币的阶段性贬值有利于向外部施加压力并给未来潜在的谈判留出空间，可控背景下的贬值持续性或超出预期，这将给境内黄金市场带来持续的支撑作用。国际黄金市场的转机或需等待四季度，随着欧日相继缩减 QE 及美国中期选取的到来，金融市场风险偏好届时有望出现转变，黄金的对冲需求有望重新受到市场关注。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |                        |                          |
| 银行存款       | 6,610,765.56           | 9,597,938.75             |
| 结算备付金      | 38,222,640.55          | 498,838,402.32           |
| 存出保证金      | 1,603,200.00           | -                        |
| 交易性金融资产    | 10,195,643,540.00      | 7,032,508,800.00         |
| 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      | 10,195,643,540.00      | 7,032,508,800.00         |
| 衍生金融资产     | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | -                      | -                        |

|                 |                           |                             |
|-----------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收证券清算款         | 133,449.00                | -                           |
| 应收利息            | 680,968.31                | 7,802,650.98                |
| 应收股利            | -                         | -                           |
| 应收申购款           | -                         | -                           |
| 递延所得税资产         | -                         | -                           |
| 其他资产            | -                         | -                           |
| <b>资产总计</b>     | <b>10,242,894,563.42</b>  | <b>7,548,747,792.05</b>     |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2018年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2017年12月31日</b> |
| <b>负债:</b>      |                           |                             |
| 短期借款            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债         | -                         | -                           |
| 衍生金融负债          | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       | -                         | -                           |
| 应付证券清算款         | -                         | 2,462,953.37                |
| 应付赎回款           | 5,700,130.14              | 257,484,688.51              |
| 应付管理人报酬         | 4,290,551.17              | 2,782,624.35                |
| 应付托管费           | 858,110.24                | 556,524.89                  |
| 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            | 0.05                      | 0.05                        |
| 递延所得税负债         | -                         | -                           |
| 其他负债            | 491,835.86                | 483,145.69                  |
| 负债合计            | 11,340,627.46             | 263,769,936.86              |
| <b>所有者权益:</b>   |                           |                             |
| 实收基金            | 9,673,730,498.55          | 6,468,087,579.25            |
| 未分配利润           | 557,823,437.41            | 816,890,275.94              |
| 所有者权益合计         | 10,231,553,935.96         | 7,284,977,855.19            |
| 负债和所有者权益总计      | 10,242,894,563.42         | 7,548,747,792.05            |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金场内份额净值 2.6647 元，D 类场外份额净值为 2.7042 元，I 类场外份额净值为 2.6580 元。场内份额为 3,057,121,977.00 份，D 类场外份额为 13,227,561.10 份，I 类场外份额为 771,044,871.98 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018年1月1日至<br>2018年6月30日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年<br>6月30日 |
|-------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、收入</b> | <b>-38,300,959.88</b>          | <b>234,785,750.73</b>               |
| 1. 利息收入     | 4,920,867.02                   | 12,952,388.07                       |
| 其中：存款利息收入   | 194,597.28                     | 378,919.32                          |
| 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                 | 4,726,269.74    | 12,573,468.75  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 70,679,467.77   | 113,043,944.92 |
| 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                | 70,841,447.77   | 112,098,421.10 |
| 衍生工具收益                 | -161,980.00     | 945,523.82     |
| 股利收益                   | -               | -              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -114,174,304.77 | 108,664,591.78 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -               | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 273,010.10      | 124,825.96     |
| 减：二、费用                 | 28,628,519.10   | 18,346,626.55  |
| 1. 管理人报酬               | 17,819,052.54   | 9,949,598.20   |
| 2. 托管费                 | 3,563,810.40    | 1,989,919.54   |
| 3. 销售服务费               | -               | -              |
| 4. 交易费用                | 1,913,205.93    | 5,108,736.98   |
| 5. 利息支出                | -               | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出          | -               | -              |
| 6. 税金及附加               | -               | -              |
| 7. 其他费用                | 5,332,450.23    | 1,298,371.83   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    | -66,929,478.98  | 216,439,124.18 |
| 减：所得税费用                | -               | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      | -66,929,478.98  | 216,439,124.18 |

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                 | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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）                    | 6,468,087,579.25                      | 816,890,275.94  | 7,284,977,855.19   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）           | -                                     | -66,929,478.98  | -66,929,478.98     |
| 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）  | 3,205,642,919.30                      | -192,137,359.55 | 3,013,505,559.75   |
| 其中：1. 基金申购款                        | 12,491,002,304.80                     | 799,645,662.86  | 13,290,647,967.66  |
| 2. 基金赎回款                           | -9,285,359,385.50                     | -991,783,022.41 | -10,277,142,407.91 |
| 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)                                  |                                 |                   |                    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 9,673,730,498.55                | 557,823,437.41    | 10,231,553,935.96  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017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）                        | 4,466,796,097.01                | 403,567,331.83    | 4,870,363,428.84   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 216,439,124.18    | 216,439,124.18     |
| 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）      | 66,752,974.89                   | -28,327,558.14    | 38,425,416.75      |
| 其中：1. 基金申购款                            | 16,691,948,519.85               | 2,390,786,357.24  | 19,082,734,877.09  |
| 2. 基金赎回款                               | -16,625,195,544.96              | -2,419,113,915.38 | -19,044,309,460.34 |
| 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） | -                               | -1,706,268.56     | -1,706,268.56      |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 4,533,549,071.90                | 589,972,629.31    | 5,123,521,701.21   |

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[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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉

的决定》、深府办[2011]60 号《深圳市地方教育附加征收管理暂行办法》、国税发明电[2002]47 号《黄金交易增值税征收管理办法》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。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。

(3) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### 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<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 17,819,052.54                            | 9,949,598.20                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 32,723.33                                | 11,282.91                                     |

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。

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至<br>2018年6月30日 |                          | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至<br>2017年6月30日 |                              |
|----------------|--------------------------------|--------------------------|-------------------------------------|------------------------------|
|                | 持有的基金<br>份额                    | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 | 持有的基金<br>份额                         | 持有的基金<br>份额占基金<br>总份额的比<br>例 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,563,810.40                   |                          | 1,989,919.54                        |                              |

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。

#### 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

#### 博时黄金 ETF

份额单位：份

| 关联方名称             | 博时黄金 ETF 本期末<br>2018年6月30日 |                          | 博时黄金 ETF 上年度末<br>2017年12月31日 |                              |
|-------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------------|------------------------------|
|                   | 持有的基金<br>份额                | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 | 持有的基金<br>份额                  | 持有的基金<br>份额占基金<br>总份额的比<br>例 |
| 招商证券              | 8,202,675.00               | 0.27%                    | 3,868,696.00                 | 2.06%                        |
| 博时黄金 ETF 联接<br>基金 | 3,007,297,900.00           | 98.37%                   | 142,897,900.00               | 76.16%                       |

#### 博时黄金 ETF 场外 D 类

无。

#### 博时黄金 ETF 场外 I 类

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<br>2018年1月1日至2018年6月<br>30日 |           | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年6月<br>30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  | 6,610,765.56                   | 30,069.85 | 10,046,269.06                       | 33,238.37 |

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。

#### 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（2018 年 6 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。

#### 6.4.6 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 2018 年 6 月 30 日，本基金申购场内基金份额的对价总额为 12,109,479,200.22 元(2017 年度：1,419,149,141.49 元)，其中包括以黄金合约支付的申购款 11,960,990,430.00 元(2017 年度：1,208,411,940.00 元)和以现金支付的申购款 148,488,770.22 元(2017 年度：210,737,201.49 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 2018 年 6 月 30 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 10,195,643,540.00 元，无属于第二层次以及第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 7,032,508,800.00 元，无属于第二层次以及第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 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。

## § 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  | 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             | 10,195,643,540.00 | 99.54         |
| 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      | 44,833,406.11     | 0.44          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,417,617.31      | 0.02          |
| 9  | 合计                | 10,242,894,563.42 | 100.00        |

### 7.2 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。

### 7.3 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。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

无。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

### 7.7 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。

### 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 | 37,935,000.00 | 10,143,060,300.00 | 99.14        |
| 2  | AU9995 | AU9995 | 197,000.00    | 52,583,240.00     | 0.51         |

### 7.9 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   | 1,603,200.00 |
| 2  | 应收证券清算款 | 133,449.00   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 680,968.31   |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,417,617.31 |

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>证券投资基金联接基金 |            |
|                    |              |               | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 | 持有份额                       | 占总份<br>额比例 |
| 博时黄金 ETF           | 13,231       | 231,057.51    | 20,612,788.00 | 0.67%      | 29,211,289.00  | 0.96%      | 3,007,297,900.00           | 98.37%     |
| 博时黄金<br>ETF 场外 D 类 | 133,383      | 99.17         | 6,494,761.04  | 49.10%     | 6,732,800.06   | 50.90%     | -                          | -          |
| 博时黄金<br>ETF 场外 I 类 | 9,888,894    | 77.97         | 408,272.08    | 0.05%      | 770,636,599.90 | 99.95%     | -                          | -          |
| 合计                 | 10,035,508   | 382.78        | 27,515,821.12 | 0.72%      | 806,580,688.96 | 21.00%     | 3,007,297,900.00           | 78.29%     |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

#### 博时黄金 ETF

| 序号 | 持有人名称        | 持有份额（份）          | 占上市总份额比例 |
|----|--------------|------------------|----------|
| 1  | 招商证券股份有限公司   | 8,202,675.00     | 0.27%    |
| 2  | 中信证券股份有限公司   | 5,483,292.00     | 0.18%    |
| 3  | 广发证券股份有限公司   | 4,455,580.00     | 0.15%    |
| 4  | 陆唯           | 2,837,600.00     | 0.09%    |
| 5  | 曾云           | 2,000,000.00     | 0.07%    |
| 6  | 联讯证券股份有限公司   | 1,294,941.00     | 0.04%    |
| 7  | 叶伟雄          | 714,500.00       | 0.02%    |
| 8  | 彭燕冰          | 617,000.00       | 0.02%    |
| 9  | 赵画           | 530,000.00       | 0.02%    |
| 10 | 国泰君安证券股份有限公司 | 502,000.00       | 0.02%    |
| -  | 黄金 ETF 联接基金  | 3,007,297,900.00 | 98.37%   |

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。

### 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 |
|------------------|----------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 博时黄金 ETF | -         | -        |

|  |                 |            |       |
|--|-----------------|------------|-------|
|  | 博时黄金 ETF 场外 D 类 | 180,069.44 | 1.36% |
|  | 博时黄金 ETF 场外 I 类 | 102,509.86 | 0.01% |
|  | 合计              | 282,579.30 | 0.01% |

#### 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的情况

| 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<br>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 | 10~50             |
|                                    | 博时黄金 ETF 场外 I 类 | -                 |
|                                    | 合计              | 10~50             |
| 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。

## § 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  | 187,621,977.00   | 34,934,403.75   | 2,453,609,345.12 |
| 本报告期基金总申购份额   | 4,499,700,000.00 | 696,280.55      | 427,668,316.22   |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,630,200,000.00 | 22,403,123.20   | 2,110,232,789.36 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -               | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 3,057,121,977.00 | 13,227,561.10   | 771,044,871.98   |

## § 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

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。

## 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。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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              | 2018-01-31~2018-06-30   | 142,897,900.00 | 4,341,000,000.00 | 1,476,600,000.00 | 3,007,297,900.00 | 78.29% |

#### 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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

博时基金管理有限公司  
二〇一八年八月二十九日