

## 上证自然资源交易型开放式指数证券

## [2012] 第三季度报告

基金管理人:博时基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2012年10月25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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月24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。

基金管理人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。

本报告书涉及财务数据未经审计。

本报告书自2012年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	博时上证自然资源ETF
基金主代码	510410
交易代码	510410
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2012年4月10日
报告期末基金份额总额	404,258,387份

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的权重比例构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股的调整而进行相应调整，以确保基金净值增长率与标的指数收益率之间的差额在跟踪误差允许的范围内。

本基金为被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金，主要采用完全复制法，跟踪上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金的走势。

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即上证自然资源指数收益率，该指数由价格指数。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即上证自然资源指数收益率，该指数由价格指数。

风险收益特征 本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高收益、高风险的开放式基金。

基金管理人 博时基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

§ 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(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -27,305,603.06

2.本期利润 -5,895,242.78

3.加权平均基金份额本期利润 0.0438

4.期末基金份额净值 355,403,194.72

5.期末基金份额总额 0.8791

注：1.本期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，本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本基金指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -1.59% 1.66% -1.96% 1.67% 0.37% -0.01%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：本基金于2012年4月10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3个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十三条“(C)投资范围”、“(九)投资限制”的有关规定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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

胡俊敏 基金经理 2012-4-10 - 6 胡俊敏女士，博士。1996年起先后在哈佛大学、普惠安捷伦科技、汤森路透金融公司、贝莱德全球基金公司、摩根士丹利担任研究员，2011年2月加入博时基金管理有限公司，现任博时特许价值基金、博时上证自然资源ETF及联接基金基金经理。

4.2 报告期内本基金运作合规情况说明

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》及其他各项实施细则、《证券交易所交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及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运用基金资产，为基金持有人谋取最大利益。本基金报告期内，基金管理人严格按照《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的规定执行。

4.3 异常交易行为的专项说明

报告期末本基金在异常交易行为。

4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为交易型开放式指数证券投资基金，其投资目的是尽量减少和标的指数的跟踪误差，取得与标的指数代表的市场平均回报。在本报期内我们严格按照基金合同要求，对成份股的跟踪误差、取得与标的指数代表的市场平均回报。并受全国社会保障理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金账户，公募基金总资产规模逾1290亿元人民币，累计分红574.23亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期末未发现本基金存在异常交易行为。

4.4.3 公平交易制度的执行情况

本基金在公平交易制度的执行情况。

4.4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金的业绩表现。

4.5 管理人对本基金运作的专项说明

报告期末本基金在异常交易行为。

4.6 报告期内本基金的投资策略和业绩表现说明

4.6.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在公平交易制度的执行情况。

4.6.2 报告期内基金的业绩表现

本基金的业绩表现。

4.7 报告期内本基金运作合规情况说明

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》及其他各项实施细则、《证券交易所交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及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运用基金资产，为基金持有人谋取最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等因素，本基金曾出现个别投资监控指标超标的的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金经理的个人利益未造成损害。

4.8 公平交易专项说明

4.8.1 公平交易执行的情况

4.8.2 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.3 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.4 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.5 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.6 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.7 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.8 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.9 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.10 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.11 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.12 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.13 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.14 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.15 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.16 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.17 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.18 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.19 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.20 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.21 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.22 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.23 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.24 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.25 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.26 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.27 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.28 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.29 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.30 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.31 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.32 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.33 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.34 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.35 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.36 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.37 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.38 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.39 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.40 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.41 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.42 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.43 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.44 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.45 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.46 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.47 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.48 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.49 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.50 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.51 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.52 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.53 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.54 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.55 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.56 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.57 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.58 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.59 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.60 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.61 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.62 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.63 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.64 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.65 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.66 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.67 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.68 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.69 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.70 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.71 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.72 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.73 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.74 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.75 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.76 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.77 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.78 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.79 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.80 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.81 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.82 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.83 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.84 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.85 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.86 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.87 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.88 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.89 报告期内本基金的公平交易情况

4.8.