**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:2013年8月29日**

# 博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 【2013】半年度报告摘要

### §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013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2013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

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金 |
| 基金简称 | 博时上证自然资源ETF联接 |
| 基金主代码 | 050024 |
| 交易代码 | 050024 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式指数基金的联接基金 |
| 基金合同生效日 | 2012年4月10日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 88,367,814.66份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.1.1目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 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 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2012年5月11日 |
| 基金管理人名称 | 博时基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国建设银行股份有限公司 |

2.2基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过主要投资于上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数即上证自然资源指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金,方便特定的客户群通过本基金投资上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金。本基金不参与上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金的投资管理。 |
| 业绩比较基准 | 上证自然资源指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5% |
| 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,属于高风险、高收益的开放式基金。<br>本基金为被动式投资的交易型开放式指数基金联接基金,跟踪上证自然资源指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 |

2.2.1目标基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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。 |
| 投资策略 | 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基准权重来构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。 |
| 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。该指数属于价格指数。 |
| 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,属于高风险、高收益的开放式基金。 本基金为被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金,主要采用完全复制策略,跟踪上证自然资源指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似 。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 孙麒清 | 田青 |
| | 联系电话 | 0755-83169999 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | service@bosera.com | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 95105568 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-83195140 | 010-66275853 |

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、基金托管人处 |

### §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(2013年1月1日至2013年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | -1,115,510.50 |
| 本期利润 | -23,074,130.38 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2621 |
| 本期基金份额净值增长率 | -29.29% |
| 3.1.2期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3706 |
| 期末基金资产净值 | 55,616,177.95 |
| 期末基金份额净值 | 0.6294 |

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。

上述基金业绩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

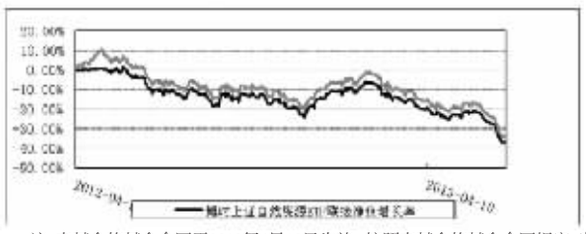
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 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 | -19.42% | 1.69% | -19.90% | 1.70% | 0.48% | -0.01% |
| 过去三个月 | -22.53% | 1.42% | -23.12% | 1.43% | 0.59% | -0.01% |
| 过去六个月 | -29.29% | 1.39% | -29.70% | 1.39% | 0.41% | 0.00% |
| 过去一年 | -29.49% | 1.44% | -29.86% | 1.44% | 0.37% | 0.00% |
| 自基金成立起至今 | -37.06% | 1.36% | -34.17% | 1.42% | -2.89% | -0.06% |

注:本基金的业绩比较基准:上证自然资源指数收益率X 95% + 银行活期存款税后利率X 5%。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照95%、5%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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十二条"(二)投资范围"、"(九)投资限制"的有关约定。截止本报告期末,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成立于1998年7月13日,是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。注册资本2.5亿元人民币,总部设在深圳,在北京、上海、郑州、沈阳、成都设有分公司。同时,博时基金公司拥有博时基金(国际)有限公司和博时资本管理有限公司两家全资子公司。博时基金公司的股东为招商证券股份有限公司、中国长城资产管理公司、天津港(集团)有限公司、璟安股权投资有限公司、上海盛业股权投资基金有限公司、上海丰益股权投资基金有限公司、广厦建设集团有限责任公司。博时基金公司的经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务,是一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构。

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2013年6月30日,博时基金公司共管理三十七只开放式基金和两只封闭式基金,并且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,公募基金资产规模逾1065.69亿元人民币,累计分红602.92亿元人民币,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,2013年上半年,股票型基金中,截至6月28日,博时医疗保健今年以来净值增长率在328只标准型股票基金中排名前1/3。混合灵活配置型基金方面,博时回报今年以来收益率在71只同类基金中排名第8。

固定收益方面,博时信用债纯债基金今年以来收益率在17只长期标准债券型基金中排名第1;博时裕祥分级债券A今年以来收益率在19只封闭式债券型分级子基金(优先份额)中名列第2。

海外投资方面,博时标普500今年以来净值增长率在15只QDII指数股票型基金中排名第2,该基金成立以来的涨幅达到15.94%。

2、客户服务

2013年上半年,博时基金共举办各类渠道培训活动逾841场,参加人数超过2万人。

3、其他大事件

1)2013年3月29日,由证券时报社主办的2012年度中国基金业明星奖颁奖典礼暨明星基金论坛在北京举行。博时主题行业基金荣获"2012年度股票型明星基金奖"。

2)2013年3月30日,由中国证券报社主办的第十届中国基金业金牛奖颁奖典礼暨2013金牛基金论坛在北京举行。博时基金蝉联"金牛基金管理公司"奖,博时基金价值组投资总监、博时主题行业基金经理邓晓峰获得"金牛基金十周年特别奖",博时现金收益荣获"2012年度货币市场金牛基金"。

3)2013年4月,在股市动态分析杂志主办的"2012基金公司品牌管理与营销策划能力排行榜"评选活动中,博时标普500指数基金获得"2012年基金新产品营销策划案例奖"。

4)2013年4月10日,由上海证券报举办的第十届"金基金奖"颁奖典礼在上海举行,博时基金荣获金"基金十年·卓越公司奖",博时裕阳封闭和博时裕隆封闭荣获"金基金十年·投资回报奖",博时主题行业基金荣获"金基金·股票型基金奖5年期奖",博时裕阳封闭荣获"金基金·分红基金奖3年期奖"。

5)2013年4月27日,由中国网、普益财富、西南财经大学信托与理财研究所三家机构联合主办的2013中国网·普益财富管理论坛在北京举行。博时基金荣获2013金手指奖评选"年度最佳财富管理基金公司"。

6)2013年6月26日,世界品牌实验室(WBL)在京发布2013年度(第十届)《中国500最具价值品牌》排行榜,博时基金以81.65亿的品牌价值位列第216名,品牌价值一年内提升了近20亿元,排名逐年上升。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 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 | | |
| 胡俊敏 | 基金经理 | 2012-4-10 | - | 6 | 1996年起先后在哈佛大学、惠普安捷伦科技、汤姆森金融公司、贝莱德全球金融公司工作,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基金及其联接基金、博时沪深300指数基金、博时标普500指数基金的基金经理。 |

注:上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。

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、《博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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

本基金主要投资于上证资源交易型开放式指数证券投资基金,以期获得和跟踪标的指数所表征的市场平均水平的收益。在报告期内,本基金严格按照基金合同,以不低于基金资产净值90%的资产都投资于上证资源交易型开放式指数证券投资基金,保证投资收益紧贴标的指数;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.6294元,累计份额净值为0.6294元,报告期内净值增长率为-29.29%,同期业绩基准涨幅为-29.70%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年上半年,市场对于经济复苏的预期在逐渐退潮。国内经济依然疲软,市场情绪整体较为低迷。从经济数据方面来看,汇丰PMI连续两个月下跌,5月出口增速回落至1%,5月的PPI为-2.9%,显示经济仍未见起色,工业生产依然较为疲弱。鉴于经济依然弱势,缺乏需求,主要周期品如煤炭、有色、钢铁等依然继续下跌。从流动性方面来看,近期流动性偏紧。从行业方面来看,煤炭产能过剩,产业链仍需要去库存;有色金属全球需求不振,中期内制约其价格。从海外市场方面来看,美国经济持续复苏,QE退出预期的逐步升温,使得全球流动性发生重构,全球资金开始从新兴市场流出,美元指数呈现上涨态势,流动性有紧缩预期,黄金和白银等金属价格大幅回落,国债收益率不断向上攀升。

展望下半年,市场环境仍然存在诸多的不确定性,其主要源于国内外政策变动对经济的调控作用。在国际方面,其主要体现在美国QE退出和日元量化宽松;在国内方面,维稳政策将在多大程度上填补房地产投资及出口增速回落所形成的空缺,各项改革措施的推进效果以及十八届三中全会的召开等都在观察之列。

在投资策略上,上证资源ETF联接基金作为一只被动的指数基金,我们会以最小化跟踪误差为目标,通过投资于上证资源ETF紧密跟踪上证资源指数。同时我们仍然看好中国长期的经济增长,希望通过上证资源ETF联接基金为投资人提供分享中国长期经济增长的机会。

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。

### §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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

### §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:博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 3,509,791.56 | 4,255,454.86 |
| 结算备付金 | 14,555.81 | - |
| 存出保证金 | 3,238.87 | - |
| 交易性金融资产 | 52,472,967.35 | 78,242,684.28 |
| 其中:股票投资 | 434,967.35 | 638,684.28 |
| 基金投资 | 52,038,000.00 | 77,604,000.00 |
| 债券投资 | - | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 5,967.99 | 251,386.43 |
| 应收利息 | 692.06 | 958.20 |
| 应收股利 | 119.97 | - |
| 应收申购款 | 14,632.17 | 24,853.79 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 56,021,965.78 | 82,775,337.56 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
| 负债: | | |
| 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 | - | - |
| 应付赎回款 | 229,858.33 | 273,268.37 |
| 应付管理人报酬 | 1,727.12 | 1,728.57 |
| 应付托管费 | 345.43 | 345.74 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 4,389.15 | 3,714.25 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 169,467.80 | 101,029.80 |
| 负债合计 | 405,787.83 | 380,086.73 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 88,367,814.66 | 92,563,627.08 |
| 未分配利润 | -32,751,636.71 | -10,168,376.25 |
| 所有者权益合计 | 55,616,177.95 | 82,395,250.83 |
| 负债和所有者权益总计 | 56,021,965.78 | 82,775,337.56 |

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.6294元,基金份额总额88,367,814.66份。

6.2利润表

会计主体:博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年4月10日(基金合同生效日)至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -22,872,477.48 | -10,916,100.83 |
| 1.利息收入 | 14,793.85 | 583,659.60 |
| 其中:存款利息收入 | 14,793.85 | 141,663.00 |
| 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 | - | 441,996.60 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -954,908.13 | -423,935.58 |
| 其中:股票投资收益 | -152,599.81 | -476,116.20 |
| 基金投资收益 | -808,624.88 | - |
| 债券投资收益 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 6,316.56 | 52,180.62 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -21,958,619.88 | -11,331,546.20 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 26,256.68 | 255,721.35 |
| 减:二、费用 | 201,652.90 | 442,194.00 |
| 1.管理人报酬 | 10,808.68 | 155,437.07 |
| 2.托管费 | 2,161.78 | 31,087.42 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 18,888.50 | 176,842.32 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 169,793.94 | 78,827.19 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -23,074,130.38 | -11,358,294.83 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -23,074,130.38 | -11,358,294.83 |

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013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) | 92,563,627.08 | -10,168,376.25 | 82,395,250.83 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -23,074,130.38 | -23,074,130.38 |
| 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) | -4,195,812.42 | 490,869.92 | -3,704,942.50 |
| 其中:1.基金申购款 | 20,870,434.43 | -3,570,897.31 | 17,299,537.12 |
| 2.基金赎回款 | -25,066,246.85 | 4,061,767.23 | -21,004,479.62 |
| 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) | 88,367,814.66 | -32,751,636.71 | 55,616,177.95 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012年4月10日(基金合同生效日)至2012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) | 309,533,849.25 | - | 309,533,849.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -11,358,294.83 | -11,358,294.83 |
| 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) | -203,683,125.87 | -2,148.72 | -203,685,274.59 |
| 其中:1.基金申购款 | 929,084.39 | -35,644.90 | 893,439.49 |
| 2.基金赎回款 | -204,612,210.26 | 33,496.18 | -204,578,714.08 |
| 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) | 105,850,723.38 | -11,360,443.55 | 94,490,279.83 |

报表附注为本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:

基金管理公司负责人:吴姚东　　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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,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。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司("中国建设银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 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 |
| 上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金("目标ETF") | 基金管理人管理的其他基金 |

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 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年4月10日(基金合同生效日)至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 10,808.68 | 155,437.07 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 69,885.24 | 60,537.57 |

注:1. 本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取管理费,支付基金管理人博时基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取零)的0.5%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 - 前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)X 0.5% / 当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议,客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.4.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年4月10日(基金合同生效日)至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,161.78 | 31,087.42 |

注:本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取零)的0.1% 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 - 前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)X 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

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 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年4月10日(基金合同生效日)至2012年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 3,509,791.56 | 14,689.41 | 4,424,119.69 | 137,555.27 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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

于2013年6月30日,本基金持有84,000,000.00份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为24.33%。

6.4.5期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

无。

### §7投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况(适用于ETF联接基金填写)

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 | 434,967.35 | 0.78 |
| | 其中:股票 | 434,967.35 | 0.78 |
| 2 | 基金投资 | 52,038,000.00 | 92.89 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | 3,524,347.37 | 6.29 |
| 7 | 其他各项资产 | 24,651.06 | 0.04 |
| 8 | 合计 | 56,021,965.78 | 100.00 |

7.2期末投资目标基金明细(适用于ETF联接基金填写)

金额单位:人民币元

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金 | 股票指数型 | 交易型开放式指数基金 | 博时基金管理有限公司 | 52,038,000.00 | 93.57 |

7.3期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 10,692.80 | 0.02 |
| B | 采矿业 | 279,354.27 | 0.50 |
| C | 制造业 | 144,920.28 | 0.26 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 434,967.35 | 0.78 |

7.4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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600997 | 开滦股份 | 4,483 | 25,553.10 | 0.05 |
| 2 | 601857 | 中国石油 | 3,317 | 25,242.37 | 0.05 |
| 3 | 600028 | 中国石化 | 5,638 | 23,566.84 | 0.04 |
| 4 | 600497 | 驰宏锌锗 | 2,300 | 22,425.00 | 0.04 |
| 5 | 601088 | 中国神华 | 1,236 | 20,937.84 | 0.04 |
| 6 | 601899 | 紫金矿业 | 7,782 | 18,521.16 | 0.03 |
| 7 | 600111 | 包钢稀土 | 842 | 17,572.54 | 0.03 |
| 8 | 600489 | 中金黄金 | 1,874 | 17,409.46 | 0.03 |
| 9 | 600362 | 江西铜业 | 975 | 15,346.50 | 0.03 |
| 10 | 600583 | 海油工程 | 2,360 | 15,269.20 | 0.03 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于博时基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

7.5报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600028 | 中国石化 | 225,894.00 | 0.27 |
| 2 | 601857 | 中国石油 | 212,794.00 | 0.26 |
| 3 | 601088 | 中国神华 | 193,746.14 | 0.24 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 189,529.00 | 0.23 |
| 5 | 600489 | 中金黄金 | 171,161.00 | 0.21 |
| 6 | 600111 | 包钢稀土 | 168,649.81 | 0.20 |
| 7 | 600362 | 江西铜业 | 157,515.00 | 0.19 |
| 8 | 601699 | 潞安环能 | 134,671.69 | 0.16 |
| 9 | 600583 | 海油工程 | 131,383.00 | 0.16 |
| 10 | 600348 | 阳泉煤业 | 130,532.80 | 0.16 |
| 11 | 601168 | 西部矿业 | 121,312.00 | 0.15 |
| 12 | 601898 | 中煤能源 | 109,476.00 | 0.13 |
| 13 | 601600 | 中国铝业 | 106,015.00 | 0.13 |
| 14 | 600123 | 兰花科创 | 105,257.00 | 0.13 |
| 15 | 601958 | 金钼股份 | 94,914.00 | 0.12 |
| 16 | 600108 | 亚盛集团 | 88,033.00 | 0.11 |
| 17 | 601808 | 中海油服 | 86,388.00 | 0.10 |
| 18 | 600549 | 厦门钨业 | 80,752.00 | 0.10 |
| 19 | 600188 | 兖州煤业 | 78,248.00 | 0.09 |
| 20 | 600497 | 驰宏锌锗 | 75,031.64 | 0.09 |

注:本项的"买入金额"均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600028 | 中国石化 | 411,058.95 | 0.50 |
| 2 | 601857 | 中国石油 | 393,385.34 | 0.48 |
| 3 | 601088 | 中国神华 | 376,266.28 | 0.46 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 369,950.26 | 0.45 |
| 5 | 600489 | 中金黄金 | 342,352.99 | 0.42 |
| 6 | 600111 | 包钢稀土 | 342,120.10 | 0.42 |
| 7 | 600362 | 江西铜业 | 308,950.14 | 0.37 |
| 8 | 601699 | 潞安环能 | 282,656.29 | 0.34 |
| 9 | 600547 | 山东黄金 | 281,177.66 | 0.34 |
| 10 | 600348 | 阳泉煤业 | 262,086.17 | 0.32 |
| 11 | 601168 | 西部矿业 | 228,296.11 | 0.28 |
| 12 | 600123 | 兰花科创 | 214,301.50 | 0.26 |
| 13 | 601898 | 中煤能源 | 213,150.61 | 0.26 |
| 14 | 601600 | 中国铝业 | 211,512.21 | 0.26 |
| 15 | 600583 | 海油工程 | 199,676.16 | 0.24 |
| 16 | 601958 | 金钼股份 | 178,847.00 | 0.22 |
| 17 | 600549 | 厦门钨业 | 162,145.52 | 0.20 |
| 18 | 600188 | 兖州煤业 | 155,745.96 | 0.19 |
| 19 | 601808 | 中海油服 | 153,402.59 | 0.19 |
| 20 | 601666 | 平煤股份 | 150,358.63 | 0.18 |

注:本项"