

(上接B045版)

联系人:刘世雄
电话:020-38286686
传真:020-22373718-1013
客户服务电话:4008888133
网址:htp://www.wlqzqcm.cn
(6)国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
办公地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:吴良志
联系人:李秦
电话:0651-2272101
传真:0651-2272100
客户服务电话:全国统一热线4008888777,安徽省内热线96888
网址:htp://www.gyzq.com.cn
(7)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址:天津市南开区滨水西道8号
法定代表人:杜庆平
联系人:胡天彤
电话:022-28451861
传真:022-28451892
客户服务电话:4006515988
网址:htp://www.bhazq.com
(8)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系人:房晓芸
电话:022-84457777
传真:025-84579763
客户服务电话:95597
网址:htp://www.htsc.com.cn/
(9)山西证券股份有限公司
注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系人:郭熠
电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客户服务电话:4006661618
网址:htp://www.jl18.com.cn/
(10)中信万通证券股份有限公司
注册地址:青岛市市南区莱阳路29号澳柯玛大厦16层
办公地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心20层
法定代表人:杨宝林
联系人:吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
客户服务电话:0532-96577
网址:htp://www.zxwt.com.cn
(11)长江证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人:陈勇力
联系人:汤继川
电话:010-66555316
传真:010-66555246
客户服务电话:4008888993
网址:htp://www.dcxq.net
(12)东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市观前街181号
办公地址:江苏省苏州市观前街181号
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
客户服务电话:4008601555
网址:htp://www.dwzq.com.cn
(13)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:赵志刚
联系人:唐静
电话:010-63800895
传真:010-63800978
客户服务电话:4008008899
网址:htp://www.cindasc.com
(14)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:郭军瑞
电话:0731-85832503
传真:0731-85832214
客户服务电话:95571
网址:htp://www.founders.com.cn
(15)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳前海南大道008号特区报业大厦14.16.17层
办公地址:深圳前海南大道008号特区报业大厦14.16.17层
法定代表人:黄耀华
联系人:高峰
电话:0755-83516094
传真:0755-83516199
客户服务电话:4006666888
网址:htp://newgw.com/
(16)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨
电话:021-22169081
传真:021-22169134
客户服务电话:400888788;95525
网址:htp://www.ebsc.com.cn/
(17)广州证券股份有限公司
注册地址:广州市先烈中路99号东山广场主楼十七楼
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人:林志勇
联系人:林洁茹
电话:020-63836999
传真:020-88936654
客户服务电话:020-961303
网址:htp://www.gzsc.com.cn
(18)东北证券股份有限公司
注册地址:吉林省长春市自由大路1138号
办公地址:吉林省长春市自由大路1138号
法定代表人:邢正中
联系人:潘倩
电话:4006-000-686
传真:0431-85067695
客户服务电话:0431-85096709
网址:htp://www.nesc.com.cn
(19)南京证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市玄武区大钟亭9号
办公地址:江苏省南京市玄武区大钟亭9号
法定代表人:王国旬
联系人:潘月
电话:025-52310569
传真:025-52310586
客户服务电话:4008285888
网址:htp://www.njzq.com.cn
(20)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
联系人:张瑾
电话:021-53519888
传真:021-63608930
客户服务电话:4008918918,021-962518
网址:www.962518.com
(21)大同证券经纪有限责任公司
注册地址:大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址:太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13
法定代表人:董祥
联系人:薛萍
电话:0351-4130322
传真:0351-4192903
客户服务电话:4007121212
网址:htp://www.dtscc.com.cn
(22)鹏华证券股份有限公司
注册地址:无锡市县前东街168号
办公地址:江苏省无锡市太湖新城金融一街9号国联金融大厦702室
法定代表人:范亮
联系人:沈刚
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
客户服务电话:400895288(全国),0510-82588168(无锡)
网址:htp://www.penghuazq.com.cn
(23)前海开源证券股份有限公司
注册地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
办公地址:杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承雄
联系人:毛建刚
电话:021-64319893
传真:0671-87901913
客户服务电话:0671-967777
网址:htp://www.stock.com.cn/
(24)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场4楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场4楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:郑智丽

电话:0755-22626172
传真:0755-82400862
客户服务电话:4008816168
网址:htp://www.pingan.com/
(25)华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市南二环路9号财智中心B1座
法定代表人:李工
联系人:甘霖
电话:0651-5161821
传真:0651-5161672
客户服务电话:0651-96518/4008096518
网址:htp://www.hazq.com/
(26)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅星路13号
办公地址:深圳市福田区竹子林粤光大厦银行大厦3楼
联系人:武斌峰
电话:0755-83707413
传真:0755-83700205
客户服务电话:400888100(全国),96100(广西)
网址:htp://www.gghzq.com.cn
(27)东海证券有限责任公司
注册地址:东莞市长安镇同富裕路1号金源中心30楼
办公地址:东莞市长安镇同富裕路1号金源中心30楼
法定代表人:张运勇
联系人:梁健伟
电话:0769-22119341
传真:0769-22116999
客户服务电话:0769-961130
网址:htp://www.dgzq.com.cn
(28)中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:菅明军
联系人:程月艳
电话:0371-65585670
传真:0371-65585665
客户服务电话:0371-9672118;4008139666
网址:htp://www.ccnew.com/
(29)东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:朱科敏
联系人:汪汇
电话:021-50586660
传真:021-58319590
客户服务电话:95531;4008888588
网址:htp://www.longone.com.cn
(30)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:许刚
联系人:王炜君
电话:021-68604866
传真:021-50372474
客户服务电话:4006208888;021-61195566
网址:htp://www.bocichina.com
(31)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:刘汝军
联系人:张同亮
电话:0471-4913998
传真:0471-4930707
客户服务电话:0471-4961259
网址:htp://www.cnht.com.cn/
(32)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市永叔路15号
办公地址:江西省南昌市北京西路8号江信国际金融大厦
法定代表人:管荣升
联系人:徐美云
电话:0791-6285337
传真:0791-6283935
客户服务电话:0791-96168
网址:htp://www.gsstock.com/
(33)华信证券有限责任公司
注册地址:四川省成都市陕西路239号
办公地址:四川省成都市陕西路239号
法定代表人:杨成刚
联系人:金法勇
电话:0755-83025723
传真:0755-83025991
客户服务电话:4008989818
网址:htp://www.hx168.com.cn
(34)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐文艺路233号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:汤世生
联系人:李璇
电话:010-88085338
传真:010-88085240
客户服务电话:4008000562
网址:htp://www.hysec.com
(35)齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路20618号
办公地址:山东省济南市经十路786号23层
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0631-81283938
传真:0631-81283900
客户服务电话:95538
网址:htp://www.lqzq.com.cn/
(36)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:卢长才
联系人:袁媛
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
客户服务电话:0755-83199699
网址:htp://www.cscoc.com.cn/
(37)第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中银时代广场B座25、26层
办公地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中银时代广场B座25、26层
法定代表人:刘学民
联系人:崔国良
电话:0755-26832852
传真:0755-26831718
客户服务电话:0755-26832852
网址:www.fscs.com
(38)中银证券有限责任公司
注册地址:南昌市抚河北路291号
办公地址:南昌市抚河北路291号
法定代表人:王宜四
联系人:余雅琳
电话:0791-6768763
传真:0791-6789414
客户服务电话:400-8866-567
网址:htp://www.avicsec.com/
(39)华林证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5.6楼
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5.6楼
法定代表人:薛荣年
联系人:杨玲
电话:0755-82707855
传真:0755-23613751
客户服务电话:全国统一客服热线4001883888 全国统一电话委托号码400802888
网址:htp://www.chinalions.com/
(40)德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人:方加春
联系人:罗芳
电话:021-68761616
传真:021-68767991
客户服务电话:4008881828
网址:htp://www.tebon.com.cn
(41)西藏证券股份有限公司
注册地址:陕西省西安市东大街232号陕西信托大厦16-17楼
办公地址:西安市西五路海惠大厦4层422室
法定代表人:刘建武
联系人:冯斌
电话:029-87406488
传真:029-87406387
客户服务电话:95582
网址:htp://www.westsecu.com/
(42)华福证券有限责任公司
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩凯
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:安冬
经办律师:吕红、安冬
4、审计计基金财产的会计师事务所
机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表:杨劲松
电话:021-61238888
传真:021-61238800
联系人:沈兆北
经办注册会计师:薛竞、沈兆北

传真:0931-4890515
客户服务电话:0931-4890619 4890618 4890100
网址:htp://www.whl2qz.com/
(43)中国国际金融有限公司
注册地址:中国北京建国门外大街1号 国贸大厦2座22层
办公地址:中国北京建国门外大街1号 国贸大厦2座22层
法定代表人:李剑阁
联系人:王雪梅
电话:010-65051166
传真:010-65051156
客户服务电话:01095679238/85679169/(0755)83195000/(021)63861196/63861196
网址:htp://www.ciccc.com.cn/
(46)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49楼
法定代表人:张永衡
联系人:赖科伟
电话:0755-23902400
传真:0755-82545500
客户服务电话:40088480028
网址:htp://www.wkzq.com.cn
(46)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
法定代表人:洪家新
联系人:陈敏
电话:021-64316642
传真:021-64333051
客户服务电话:021-32109999,029-68918888
网址:htp://www.cfsc.com.cn
(47)鹏鼎证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:程宜轩
联系人:牟冲
电话:010-5832 8112
传真:010-5832 8748
客户服务电话:4008788827
网址:htp://www.absecurities.com
(48)中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界荣超商务中心A栋第18层-21层及第40层1,02,03,05,11,12,13,15,16,18,19,20,21,22,23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
客户服务电话:4006008008
网址:htp://www.cwjzscn/
(49)中汇证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区桃园路3号新世界中心29层
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人:吴永良
联系人:李珍
电话:0755-82943755
传真:0755-82940511
客户服务电话:4001020211
网址:htp://www.zszq.com.cn
(100)日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区森林南路18号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安融中心西楼11层
法定代表人:孔凡杰
联系人:陈书彬
电话:010-88086830
传真:010-66412537
客户服务电话:010-66413306
网址:htp://www.rhxzq.com.cn
(101)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路66号
法定代表人:孙名扬
联系人:张莉北
电话:0451-85963696
传真:0451-82287211
客户服务电话:4006662288
网址:htp://www.jhzq.com.cn
(102)天源证券有限公司
注册地址:青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼
办公地址:深圳市福田区新华保险大厦18楼
法定代表人:袁东平
联系人:关键
电话:0755-33331188
传真:0755-33329815
客户服务电话:4006543218
网址:htp://www.tyzq.com.cn
(103)国金证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市东城根上街95号
办公地址:四川省成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:刘一宏
电话:028-86690072
传真:028-86690126
客户服务电话:4006-600109
网址:htp://www.gjzq.com.cn
(104)开诚民族证券有限责任公司
注册地址:北京西城区金融大街5号新盛大厦A座
办公地址:北京西城区金融大街5号新盛大厦A座613
法定代表人:赵大建
联系人:李敬
电话:010-69355941
传真:010-66553789
客户服务电话:400-889-5618
网址:htp://www.w618.com
(105)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心67楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心67楼
法定代表人:陈林
联系人:汪明理
电话:021-68777222
传真:021-68777822
客户服务电话:4008209898;021-38929908
网址:htp://www.cnhtstock.com
(106)厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅敬群
联系人:卢金文
电话:0592-5161816
传真:0592-5161102
客户服务电话:0592-51635588
网址:htp://www.xmzq.cn
(107)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人:袁克龙
联系人:戴晓娟
电话:021-32229888
传真:021-68728703
客户服务电话:021-63340678
网址:htp://www.jazq.com
(108)信达证券股份有限公司
注册地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23至26层
法定代表人:崔建杰
联系人:刘阳
电话:0311-68006393
传真:0311-68006249
客户服务电话:4006128888
网址:htp://www.xd1000.com
(109)大通证券股份有限公司
注册地址:辽宁省大连市中山区人民路24号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区会兴路129号大连期货大厦39层
法定代表人:于宏民
联系人:谢立华
电话:0411-39673202
传真:0411-39673219
客户服务电话:4008169169
网址:htp://www.daton.com.cn
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
三、出具法律意见书并签订律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
注册地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:韩凯
电话:021-31358666
传真:021-31358600
联系人:安冬
经办律师:吕红、安冬
4、审计计基金财产的会计师事务所
机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表:杨劲松
电话:021-61238888
传真:021-61238800
联系人:沈兆北
经办注册会计师:薛竞、沈兆北

第四部分 基金的名称
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
第五部分 基金的投资
ETF联接基金
第六部分 基金的投资目标
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。
第七部分 投资方式
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,标的指数即上证自然资源指数成份股和备选成份股,国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、新股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定),其目的是为了使用本基金在跟踪日常申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。
在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过0.3%,年跟踪误差不得超过0.4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
2、目标ETF投资策略
本基金对基金的投资(仅指于指定的目标ETF,目前目标ETF仅指上证自然资源ETF。
(1)投资组合的构建
基金合同生效后,本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合,并在建仓期内将股票组合转换成目标ETF,使本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值90%。
(2)目标ETF的投资方式
本基金投资目标ETF的两种方式如下:
1)申购赎回:目标ETF开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回;
2)二级市场方式:上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金上市交易后,在二级市场进行上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金份额的交易。本基金投资于目标ETF的方式以申购赎回为主,但在目标ETF二级市场流动性较好的情况下,为了更好地实现本基金的投资目标,减少与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差,也可以通过二级市场交易买卖目标ETF。
当上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。
3、股票投资策略
本基金的股票投资以标的指数成份股和备选成份股的投资为主,采用被动式指数化投资方法进行日常管理,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,但在特殊情况下(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。
4、债券投资策略
本基金债券投资组合将着重考虑基金的流动性管理及策略性投资的需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置,债券投资的目的是保证基金资产流动性,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。
5、股指期货及其他金融衍生品的投资策略
本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期风险管理。
基金管理人将建立股指期货投资决策小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报批重大决策。
第九部分 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%
如果上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金变更其标的指数,或者中国指数公司变更或停止上证自然资源指数编制及发布,或者上证自然资源指数被其他指数所替代,或者由于指数编制方法变更导致上证自然资源指数不宜继续作为本基金的目标基金,或者证券市场有其他代表性更强,更适合于本基金投资的指数推出时,经与托管人协商一致,履行相应程序后,本基金的标的指数将根据目标基金的投资目标和资产配置比例做相应的变更,而无须召开基金份额持有人大会。
第十部分 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、债券型基金及货币市场基金,属于高风险、收益波动的开放式基金。
本基金为被动式投资的投资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。
第十一部分 基金的投资组合报告
基金管理人或董事保证本报告所载数据不存在虚假记载、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。
本投资组合报告所载数据截至2014年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。
1报告期末基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	173,092,648	0.40
	其中:股票	173,092,648	0.40
2	基金投资	41,220,827.93	94.09
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	2,388,991.49	5.45
9	其他资产	26,588.22	0.06
9 合计		43,809,470.32	100.00

2期末投资组合目标明细

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联接基金	股票型 联接基金	交易型开放式 基金	博时基金 有限公司	41,220,827.93	94.45

3报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,948.70	0.01
B	采矿业	105,963.72	0.24
C	制造业	52,336.62	0.12
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	2,630.92	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、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	7,212.72	0.02
合计		173,092,648	0.40

4报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600392	盛和资源	932	17,027.64	0.04
2	600028	中国石化	1,876	9,436.28	0.02
3	601857	中国石油	1,150	8,746.00	0.02
4	601899	紫金矿业	3,532	7,947.00	0.02
5	601088	中国神华	531	7,343.73	0.02
6	602056	广汇能源	984	7,212.72	0.02
7	601918	国投新集	2,211	6,831.99	0.02
8	600111	包钢稀土	313	6,266.26	0.01
9	600583	海油工程	720	5,890.50	0.01
10	600489	中金黄金	711	5,688.00	0.01

5报告期末按债券品种和分类的债券投资组合
本基金本报告期末未有债券。
6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债券投资明细
本基金本报告期末未有债券。
7报告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有资产支持证券。
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
本基金本报告期末未有贵金属投资。
9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权证投资明细
本基金本报告期末未有权证。
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有股指期货投资。
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有国债期货。

12 投资组合报告附注
12.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除中国石油化工股份有限公司(600028)外,没有出现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、处罚的情形。
中国石油化工股份有限公司于2014年1月12日发布公告称,国务院对山东省青岛市“1122”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理意见,认定是一起特别重大责任事故;同意对事故有关责任单位和责任人的处理意见,对中国石化及当地政府的 48 名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的 15 名责任人移送司法机关依法追究法律责任。
对该股票投资决策程序的说明:
根据我们的基金投资管理相关制度,以相应的研究报告为基础,结合其未来增长前景,由基金经理决定具体投资行为。
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。
12.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,315.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	563.29
5	应收申购款	23,679.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,588.22

12.4 报告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换债券。
12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
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。
第十二部分 基金业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
自基金合同生效开始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:

期 间	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准差④	①-③	②-④
一、 2012/4/1-2014/3/31	-45.15%	1.37%	-42.33%	1.41%	-2.82%	0.04%
二、 2014/1/1-2014/3/31	-8.63%	1.26%	-8.40%	1.27%	-0.23%	0.01%
三、 2013/1/1-2013/12/31	-32.56%	1.41%	-32.78%	1.43%	0.22%	0.02%
四、 2012/4/1-2012/12/31	-10.99%	1.34%	-6.30%	1.43%	-4.63%	0.09%

第十三部分 基金费用与税收
一、与基金运作有关的费用
(一)基金费用的种类
1.基金管理人的管理费;
2.基金托管人的托管费;
3.基金财产划支付行的银行费用;
4.基金合同生效后的基金信息披露费;
5.基金份额持有人大会费;
6.基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费;
7.基金的证券交易费用;
8.证券账户开户费用、银行账户维护费;
9.依法可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年管理费率÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金管理费。
前一日基金资产净值=已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净额,金额为负时以零计。
基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
2.基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管人对本基金投资组合中投资于目标ETF部分的基金资产净值不计提基金托管费。
前一日基金资产净值=已扣除本基金投资于目标ETF部分基金资产净值后的净额,金额为负时以零计。
基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
3.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
二、与销售有关的费用
1.申购赎回费用

申购金额(M)	申购费率</
---------	--------