

上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.0115元,份额累计净值为1.0115元,报告期内净值增长率为30.97%,同期业绩基准涨幅为30.87%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年下半年,从宏观经济角度来看,尽管几大重要指数数据显示经济仍在底部,但是有望逐步实现企稳。预计财政政策将作为更主要的调控工具,改革推进速度方向不变。海外方面,美联储仍有预期在9月启动加息,届时国内资金或将面临外流压力,因而三季度货币政策仍然可能进一步放松。股票市场将呈现震荡调整的格局,但是下行风险有限。部分低估值大盘蓝筹股以及绩优成长股仍然具备投资价值。在投资策略上,上证资源ETF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,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 管理人对于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,基金估值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。

参与估值流程的各方还包括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净值及净值计算履行复核责任,当存在异议时,托管银行有责任要求基金管理人作出合理解释,通过积极沟通达成一致意见。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。

2. 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 管理人对于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 报告期内管理人对于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,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、托管协议及其他有关规定,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关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内容、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:上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
流动资产:		
货币资金	2,036,224.67	1,263,499.41
结算备付金	1,269,063.77	15,414.42
存出保证金	15,194.99	2,560.02
交易性金融资产	140,573,366.68	103,483,421.00
其中:股票投资	140,573,366.68	103,483,421.00
基金投资	67,430,442.00	47,741.44
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	51,946.06	62.30
应收利息	974.91	270.54
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	143,872,778.08	106,126,884.48
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	-	-
应付票据	-	-
应付账款	67,047.06	79,580.06
应付托管费	13,589.61	15,967.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费	190,894.94	59,570.07
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	248,364.28	90,000.00
负债合计	926,402.36	301,026.65
所有者权益:		
实收基金	141,258,387.00	262,268,387.00
未分配利润	1,621,989.62	-57,433,531.97
所有者权益合计	142,880,376.62	104,834,855.03
负债和所有者权益总计	143,872,778.08	106,126,884.48

注:本报告截止日2015年06月30日,基金份额净值1.0115元,基金份额总额141,258,387.00份。

6.2 利润表

会计主体:上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	62,829,688.02	-12,790,974.64
1.利息收入	10,946.09	5,223.06
其中:存款利息收入	10,946.09	5,223.06
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	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	76,217,671.26	-35,077,911.07
其中:股票投资收益	74,638,966.96	-36,170,878.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资损益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具损益	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	87.96,794.29	1,092,967.18
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-13,329,348.94	22,291,157.75
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	930,633.02	-9,446.26
减:二、费用	1,104,399.32	618,621.63
1. 管理人报酬	565,656.63	402,479.62
2. 托管费	101,131.28	80,456.06
3. 销售服务费	199,047.13	37,068.10
4. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	296,564.28	298,577.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	61,726,409.50	-13,609,590.09
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	61,726,409.50	-13,609,590.09

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	262,268,387.00	-57,433,531.97
2.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	61,726,409.50
三、本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)	-111,000,000.00	-2,689,078.31
其中:1.基金申购款	4,642,000,000.00	269,816,121.08
2.基金赎回款	-4,763,000,000.00	-272,486,099.39
四、本期所有者权益(基金净值)	141,258,387.00	1,621,989.62
五、期末所有者权益(基金净值)	141,258,387.00	142,880,376.62

注:1.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)为-13,609,590.09元

2.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

3.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

4.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

5.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

6.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

7.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

8.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

9.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

10.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

11.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

12.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

13.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

14.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

15.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

16.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

17.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

18.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

19.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

20.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

21.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

22.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

23.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

24.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

25.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

26.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

27.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

28.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

29.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

30.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

31.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

32.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

33.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

34.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

35.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

36.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

37.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

38.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

39.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

40.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

41.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

42.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

43.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

44.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

45.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

46.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

47.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

48.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

49.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

50.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

51.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

52.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

53.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

54.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

55.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

56.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

57.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

58.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

59.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

60.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

61.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

62.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

63.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

64.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

65.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

66.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

67.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

68.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

69.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

70.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

71.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

72.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

73.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

74.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

75.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

76.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

77.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

78.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

79.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

80.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

81.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

82.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

83.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

84.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

85.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

86.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

87.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

88.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

89.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

90.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元

91.本期基金净值变动的其他来源(净值变动数以“-”号填列)为-111,000,000.00元