（上接B072版）

(1)国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：杨德红
联系人：芮敏祺
电话：021－38676666
传真：021－38670161
客户服务电话：95521
网址：www.gtja.com
(2)中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：刘畅
电话：010-65608231
传真：010－65182261
客户服务电话：4008888108/95587
网址：http://www.csc108.com/
(3)国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：刘晓东
电话：0755-82130509
传真：0755－82133952
客户服务电话：95536
网址：http://www.guosen.com.cn/
(4)招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38－45层
办公地址：中国深圳福田区益田路江苏大厦A座30楼
法定代表人：霍达
联系人：黄婵君
电话：0755-82943666
传真：0755-83734343
客户服务电话：4008888111;95565
网址：http://www.newone.com.cn/
(5)广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
电话：020－87555888
传真：020－87555305
客户服务电话：95575或致电各地营业网点
网址：http://www.gf.com.cn/
(6)中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：张佑君
联系人：马静懿
电话：010-60833889
传真：010－84865560
客户服务电话：400-889-5548/95548
网址：http://www.cs.ecitic.com/
(7)中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2－6层
法定代表人：陈共炎
联系人：辛国政
电话：010-83574507
传真：010-66568990
客户服务电话：95551/4008888888
网址：http://www.chinastock.com.cn/
(8)海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：周杰
联系人：李笑鸣
电话：021-23219275
传真：021－63602722
客户服务电话：95553
网址：http://www.htsec.com/
(9)申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
联系人：李玉婷
电话：021-33389888
传真：021-33388224
客户服务电话：95523或4008895523
网址：www.swhysc.com
(10)兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人：兰荣
联系人：谢高得
电话：021－38565785
传真：021－38565783
客户服务电话：4008888123/95562
网址：http://www.xyzq.com.cn/
(11)长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：尤习贵
联系人：奚博宇
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务电话：95579;4008-888-999
网址：http://www.95579.com/
(12)安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人：王连志
联系人：刘志斌
电话：0755-82558323
传真：0755－82558355
客户服务电话：95517,4008001001
网址：http://www.essence.com.cn
(13)西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
联系人：张煜
电话：023-63786633
传真：023-63786212
客户服务电话：4008096096
网址：http://www.swsc.com.cn
(14)湘财证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人：林俊波
联系人：钟康莺
电话：021－68634518－8503
传真：021－68865938
客户服务电话：4008881551
网址：http://www.xcsc.com/
(15)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：凤良志
联系人：李蔡
电话：0551－2272101
传真：0551－2272100
客户服务电话：全国统一热线4008888777,安徽省内热线96888
网址：http://www.gyzq.com.cn
(16)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：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：王春峰
联系人：胡天彤
电话：022－28451861
传真：022－28451892
客户服务电话：4006515988
网址：http://www.bhzq.com
(17)华泰证券股份有限公司
注册地址：南京市江东中路228号
办公地址：办公地址南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼
法定代表人：周易
联系人：庞晓芸
电话：0755-82492193
传真：0755-82492962（深圳）
客户服务电话：95597
网址：http://www.htsc.com.cn/
(18)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：http://www.i618.com.cn/
(19)中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东2、5层
法定代表人：姜晓林
联系人：孙秋月
电话：0532-85022026
传真：0532-85022605
客户服务电话：95548
网址：http://www.zxzqsd.com.cn/
(20)东兴证券股份有限公司
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：徐勇力
联系人：汤漫川
电话：010-66555316
传真：010-66555246
客户服务电话：4008888993
网址：http://www.dxzq.net
(21)东吴证券股份有限公司
注册地址：江苏省苏州市翠园路181号
办公地址：江苏省苏州市星阳街5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：http://www.dwjq.com.cn
(22)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：张志刚
联系人：尹旭航
电话：010－63081493
传真：010－63081344
客户服务电话：95321
网址：http://www.cindasc.com
(23)东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层－29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层－29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：胡月茹
电话：021－63325888
传真：021－63326729
客户服务电话：95503
网址：http://www.dfzq.com.cn
(24)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：http://www.foundersc.com
(25)长城证券股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦16、17层
办公地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：丁益
联系人：高峰
电话：0755－83516094
传真：0755－83515567
客户服务电话：4006666888
网址：http://www.cgws.com
(26)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：周健男
联系人：李芳芳
电话：021-22169089
传真：021－22169134
客户服务电话：4008888788;95525
网址：http://www.ebscn.com/
(27)广州证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人：邱三发
联系人：林洁茹
电话：020－88836999
传真：020－88836654
客户服务电话：95396
网址：http://www.gzs.com.cn
(28)东北证券股份有限公司
注册地址：长春市生态大街6666号
办公地址：长春市生态大街6666号
法定代表人：李福春
联系人：安岩岩
电话：0431-85096517
传真：0431-85096795
客户服务电话：95360
网址：http://www.nesc.cn
(29)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8号
办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人：步国旬
联系人：潘月
电话：025－52310569
传真：025－52310586
客户服务电话：4008285888
网址：http://www.njzq.com.cn
(30)国联证券股份有限公司
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8号国联金融大厦702室
法定代表人：范炎
联系人：沈刚
电话：0510－82831662
传真：0510－82830162
客户服务电话：95570/4008885288（全国）,0510-82588168（无锡）
网址：http://www.glsc.com.cn
(31)浙商证券股份有限公司
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：吴承根
联系人：张智
电话：021-64718888
传真：0571－87901913
客户服务电话：95345
网址：http://www.stocke.com.cn/
(32)平安证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：广东省深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：何之江
联系人：周驰
电话：18612835256
传真：0755－82400862
客户服务电话：0755-22628888/95511-8
网址：http:\\www.stock.pingan.com
(33)华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：安徽省合肥市南二环959号财智中心B1座
法定代表人：李工
联系人：甘霖
电话：0551－65161821
传真：0551－65161672
客户服务电话：0551-96518/4008096518/95318
网址：http://www.hazq.com/
(34)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四路光大银行大厦3楼
法定代表人：张雅锋
联系人：武斌
电话：0755－83707413
传真：0755－83700205
客户服务电话：4008888100（全国）,96100（广西）
网址：http://www.ghzq.com.cn
(35)东莞证券有限责任公司
注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：
联系人：李荣
电话：0769-22116572
传真：0769-22115712
客户服务电话：95328
网址：http://www.dgzq.com.cn
(36)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：晋明军
联系人：程月艳
电话：0371—65585670
传真：0371--65585665
客户服务电话：0371-967218;4008139666
网址：http://www.ccnew.com/
(37)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：王炜哲
电话：021－68604866
传真：021－50372474
客户服务电话：4006208888;021-61195566
网址：http://www.bocichina.com
(38)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：http://www.cnht.com.cn/
(39)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88 号江信国际金融大厦
法定代表人：徐丽峰
联系人：汪代强
电话：0791－6285337
传真：0791－6289395
客户服务电话：4008222111
网址：https://www.gszq.com/
(40)华西证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市陕西街239号
办公地址：四川省成都市陕西街239号
法定代表人：杨炯阳
联系人：张曼
电话：010-68716150
传真：028-86150040
客户服务电话：4008888818/95584
网址：http://www.hx168.com.cn
(41)申万宏源西部证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：李季
联系人：唐岚
电话：010－88085201
传真：010－88085195
客户服务电话：4008000562
网址：http://www.hysec.com
(42)中泰证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市经十路20518号
办公地址：山东省济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531－81283938
传真：0531-68889357
客户服务电话：95538
网址：www.zts.com.cn
(43)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：姜昧军
联系人：袁媛
电话：0755－83199511
传真：0755－83199545
客户服务电话：0755-83199599/4008323000
网址：http://www.csco.com.cn/
(44)中航证券有限公司
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：余雅娜
电话：0791-6768763
传真：0791-6789414
客户服务电话：400-8866-567
网址：http://www.avicsec.com/
(45)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：耿贵波
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 4008802888
网址：http://www.chinalions.com/
(46)德邦证券股份有限公司
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：021-68767981
客户服务电话：4008888128
网址：http://www.tebon.com.cn
(47)华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张宗悦
电话：0591－87383623
传真：0591－87383610
客户服务电话：95547
网址：http://www.hfzq.com.cn
(48)华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富大厦
法定代表人：李晓安
联系人：范坤/杨力
电话：0931-4890208,18993185278(范)/18993037287（杨）
传真：0931-4890628
客户服务电话：95368/0931-4890619 4890618 4890100
网址：http://www.hlzqgs.com/
(49)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：95323,021-32109999,029-68918888
网址：http://www.cfsc.com.cn
(50)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处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、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：高涛
联系人：万玉琳
电话：0755-82026907
传真：0755-82026539
客户服务电话：4006008008/95532
网址：http://www.china-invs.cn/
(51)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56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张背北
电话：0451-85863696
传真：0451－82287211
客户服务电话：4006662288
网址：http://www.jhzq.com.cn
(52)九州证券有限公司
注册地址：青海省西宁市城中区西大街11号
办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心D座5层
法定代表人：曲国辉
联系人：刘中华
电话：010-63889326
传真：－
客户服务电话：4006543218
网址：http://www.tyzq.com.cn
(53)中国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：李微
电话：010-59355941
传真：010-66553791
客户服务电话：400-889-5618/95571
网址：http://www.e5618.com
(54)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57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57楼
法定代表人：陈林
联系人：刘闻川
电话：021-68777222
传真：021－68777822
客户服务电话：4008209898;021-38929908
网址：http://www.cnhbstock.com
(55)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：钱华
联系人：戴莉丽
电话：021－32229888
传真：021- 68728703
客户服务电话：021-63340678
网址：http://www.ajzq.com
(56)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展路129号大连期货大厦39层
法定代表人：于宏民
联系人：谢立军
电话：0411-39673202
传真：0411-39673219
客户服务电话：4008169169
网址：http://www.daton.com.cn
2、二级市场交易代理券商
包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。
3、基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减销售本基金的代理机构，并及时公告。
二、登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
电 话：0755-25946013
传 真：0755-25987122
联系人：严峰
三、出具法律意见书的律师事务所
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：俞卫锋
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：安冬
经办律师：安冬、孙睿
四、审计基金财产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙）
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：沈兆杰
经办注册会计师：张振波、沈兆杰

第四部分 基金的名称

上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

第五部分 基金的类型

交易型开放式

第六部分 基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

第七部分、投资方向

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于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的股票）、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或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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后， 本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

第八部分、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。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具，包括融资融券等。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，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董事会批准。

第九部分、基金的业绩比较基准

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。

如果中证指数有限公司变更或停止上证自然资源指数的编制及发布，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等重大变更导致上证自然资源指数不宜继续作为本基金的标的指数，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，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，经与托管人协商一致，在履行适当程序后有权变更本基金的标的指数并相应地变更业绩比较基准，而无须召开基金份额持有人大会。

第十部分、基金的风险收益特征

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。

第十一部分、基金的投资组合报告

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2018年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	91,333,802.23	98.61
	其中:股票	91,333,802.23	98.61
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	1,284,888.62	1.39
7	其他各项资产	1,276.36	0.00
8	合计	92,619,967.21	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,146,487.09	1.24
B	采矿业	56,010,685.33	60.73
C	制造业	33,394,001.81	36.21
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	782,628.00	0.85
	合计	91,333,802.23	99.03

3 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	601857	中国石油	618,470	5,671,369.90	6.15
2	600028	中国石化	787,991	5,610,495.92	6.08
3	601225	陕西煤业	594,800	5,174,760.00	5.61
4	601899	紫金矿业	1,346,747	4,807,886.79	5.21
5	601088	中国神华	234,672	4,784,962.08	5.19
6	601600	中国铝业	1,048,688	4,226,212.64	4.58
7	600516	方大炭素	169,479	3,794,634.81	4.11
8	603799	华友钴业	70,620	3,763,339.80	4.08
9	600111	北方稀土	345,475	3,534,209.25	3.83
10	600256	广汇能源	641,011	3,275,566.21	3.55

4 报告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。

5 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持有债券。

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 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持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 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。

10 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。

11投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,018.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	258.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,276.36

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5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。

11.6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 基金的业绩

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
2012/4/10-2012/12/31	-10.80%	1.44%	-6.79%	1.50%	-4.01%	-0.06%
2013/1/1-2013/12/31	-33.81%	1.49%	-34.27%	1.50%	0.46%	-0.01%
2014/1/1-2014/12/31	30.81%	1.35%	30.19%	1.35%	0.62%	0.00%
2015/1/1-2015/12/31	-8.75%	2.94%	-8.94%	2.96%	0.19%	-0.02%
2016/1/1-2016/12/31	-4.58%	1.82%	-3.46%	1.84%	-1.12%	-0.02%
2017/1/1-2017/12/31	21.00%	1.11%	17.19%	1.14%	3.81%	-0.03%
2018/1/1-2018/9/30	-18.60%	1.38%	-19.08%	1.44%	0.48%	-0.06%
2012/4/10-2018/9/30	-33.77%	1.76%	-33.51%	1.79%	-0.26%	-0.03%

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、基金上市费及年费；

4、基金的指数使用费；

5、基金收益分配发生的费用；

6、基金财产拨划支付的银行费用；

7、基金合同生效后的基金信息披露费用；

8、基金份额持有人大会费用；

9、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

10、基金的证券交易费用；

11、证券账户开户费用、银行账户维护费用；

12、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0.50%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5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5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、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付指数使用费。在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.03%的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

H＝E×0.03%/当年天数

H为每日应付的指数许可使用费，E为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费按季支付。根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的规定，指数许可使用费的收取下限为每季人民币50,000元（即不足50,000元部分按照50,000元收取）但基金合同生效当季，指数许可使用费不设下限，按实际计提的金额支付。

如果指数许可使用费的计算方法、费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时通知基金托管人，并按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。

4、除管理费、托管费及指数许可使用费之外的基金费用，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、与基金销售有关的费用

1、申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

2、申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。

申购、赎回清单由基金管理人编制，T日的申购、赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。申购、赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

3、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

4、T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。

三、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

四、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

五、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2018年5月25日刊登的本基金原招募说明书（《博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》）进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

1、在“二、释义”中，对简称的含义进行了更新；

2、在“三、基金管理人”中，对基金管理人的基本情况进行了更新；

3、在“四、基金托管人”中，对基金托管人的基本情况进行了更新；

4、在“五、相关服务机构”中，对基金份额发售机构进行了更新；

4、在“十、基金的投资”中，更新了“（十一）基金投资组合报告”的内容，数据内容截止时间为2018年9月30日；

5、在“十一、基金的业绩”中，更新了基金业绩的内容，数据内容截止时间为2018年9月30日；

6、在“二十三、其它应披露的事项”中根据最新情况对相关应披露事项进行了更新：

(一)、2018年09月29日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投业务费率优惠活动的公告》；

(二)、2018年09月25日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加民商基金销售（上海）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；

(三)、2018年08月29日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金2018年半年度报告（摘要）》；

(四)、2018年08月23日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《关于博时旗下部分开放式基金增加南京途牛金融信息服务有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；

(五)、2018年07月20日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金2018年第2季度报告》；

(六)、2018年06月29日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《20180629关于博时基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购及定投业务费率优惠活动的公告》；

(七)、2018年05月25日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书2018年第1号（正文）》；

(八)、2018年05月25日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书2018年第1号（摘要）》；

(九)、2018年04月20日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金2018年第1季度报告》；

(十)、2018年04月13日，我公司分别在中国证券报、上海证券报、证券时报上公告了《20180413关于博时旗下部分开放式基金增加深圳盈信基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告》；

博时基金管理有限公司
2018年11月24日