

# 上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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:2015年7月18日

\$1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、完整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，于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等内容，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

## \$2 基金产品概况

基金简称	博时上证自然资源ETF
场内简称	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6日
报告期末基金份额总额	141,258,387.00份

## \$3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	(单位:人民币元)
报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)	
1.本期已实现收益	60,506,414.26
2.本期利润	33,522,217.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.2390
4.期末基金份额净值	142,880,376.62
5.期末基金份额总额	1,011,15

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 本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	净值增长率为①	净值增长率为②	净值增长率为③	净值增长率为④	净值增长率为⑤
过去三个月	14.47%	2.85%	14.22%	2.89%	0.25%

3.2.2 基金合同生效以来基金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



## \$4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
万鹏	基金经理	2015-06-08	-	8 万鹏先生于2004年起在深圳宝利达公司担任项目经理，2010年加入博时基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理、基金经理，现任基金经理。万鹏先生拥有10年证券从业经验，具备丰富的行业研究经验，投资风格稳健，注重基本面分析，擅长把握行业轮动机会，善于挖掘个股的投资价值。
方维玲	指数投资部总监兼基金经理	2013-09-13	-	23.5 方维玲女士于1982年7月生，先后在上海交通大学、海南大学信息管理学院、海南大学经济学院攻读本科、硕士、博士研究生，2005年7月获得海南大学管理科学与工程专业博士学位。2005年7月至2007年1月就职于海南证券有限责任公司，任基金理财专员，数年后辞职。2007年7月加入博时基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理、基金经理，现任基金经理。方维玲女士拥有23年证券从业经验，擅长把握行业轮动机会，善于挖掘个股的投资价值。

4.2 管理人对报告期内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、本基金合同和相关法律法规的规定，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基金，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 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

报告期内未发现基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年2季度，宏观经济数据企稳迹象显现，从流动性方面来看，上半年货币政策持续宽松，央行多次降准降息，6月份前，各股呈现创新高，以创业板为代表的新兴成长股表现，互联网、电子、计算机等行业股票涨幅较大，而以沪深300为代表的蓝筹股表现较弱，6月份后，随着经济企稳，货币政策将更加侧重于结构性调整，改革推进将逐步方向不变。海外方面，美联储将再次启动加息，届时国际金价或将面临外流压力，因而在3季度货币仍将可能进一步宽松。股票市场将呈现震荡调整的格局，但是下风险有限。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作为一种被动的指数基金，我们会以最大优化跟踪误差为目标，紧密跟踪上证资源指数。同时我们仍然看好中国经济的增长，希望通过上证资源ETF为投资人提供分享中国经济长期经济增长的机会。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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。

4.6 管理人对宏观经济的判断情况

报告期内，本基金管理人对宏观经济的判断情况。

4.7 报告期内基金运作合规情况说明

博时基金管理有限公司严格按照《证券投资基金法》及《证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定，履行诚实守信、勤勉尽责的义务，履行受托管理职责，保护基金份额持有人的合法权益，确保基金的合法运作。

4.8 报告期内基金持有数或基金资产净值预警说明

本基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

## \$5 投资组合报告

5.1 基金期末基金份额组合情况

5.1.1 项目

金额(元)

占基金总资产的比例(%)

1 权益投资

140,573,395.68 97.71

其中:股票

-

2 固定收益投资

-

3 货币市场基金

-

4 金融衍生品投资

-

5 其他金融类资产

-

其中:次级类别的买入返售金融资产

-

6 银行存款和结算备付金合计

3,231,278.34 2.25

7 其他各项资产

68,104.96 0.05

8 合计

143,872,778.98 100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 行业配置

140,573,395.68 97.71

2 其他

-

3 采矿业

-

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

5 建筑业

-

6 交通运输、仓储和邮政业

-

7 钢铁行业

-

8 其他

-

9 合计

140,573,395.68 97.71

5.1.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 行业配置

140,573,395.68 97.71

2 其他

-

3 采矿业

-

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

5 建筑业

-

6 交通运输、仓储和邮政业

-

7 钢铁行业

-

8 其他

-

9 合计

140,573,395.68 97.71

5.1.4 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 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国神华 3,032,413.44 2.12

2 宝钢股份 89,842,510.42 62.88

3 新钢股份 43,823,444.66 30.67

4 中国建筑 4,826,817.00 3.31

5 中国中铁 3,875,018.16 2.71

6 交通银行 7,283,717.10 5.10

7 中国国电 7,002,866.04 4.90

8 中国交建 6,632,176.64 4.64

9 中国铝业 6,077,687.20 4.25

10 中国铁建 6,245,470.23 4.40

11 中国国航 4,401,843.01 3.08

12 中国石化 6,245,470.23 4.29

13 中国国旅 4,296,883.36 3.01

14 中国太保 3,875,018.16 2.71

15 中国平安 3,875,018.16 2.71

16 中国石油 3,875,018.16 2.71

&lt;p