

上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

[2017] 第一季度报告

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:二〇一七年四月二十二日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及其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保证本基金合同符合法律规定，于二〇一七年四月二十二日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、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自二〇一七年一月一日起至二〇一七年三月三十一日止。

§ 2 基金产品概况

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	600088	中国中化	215,672	4,175,409.02	6.57
2	600028	中国石化	690,791	3,995,193.04	6.29
3	601087	中国石油	482,070	3,800,180.80	6.07
4	601099	冀东水泥	1,940,847	3,546,102.06	4.73
5	601000	中国国电	759,089	3,529,294.20	4.70
6	600111	北方稀土	261,575	3,046,075.25	4.06
7	600047	山东黄金	84,764	3,032,860.02	4.04
8	600499	中金黄金	197,170	2,310,320.40	3.08
9	600157	永泰能源	572,247	2,266,088.12	3.02
10	600906	潞安环能	446,611	2,086,872.61	2.80

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标		报告期	2017年1月1日-2017年3月31日
1.本期利润			70,728.60
2.本期利润			2,026,496.74
3.加权平均基金份额本期利润			0.0240
4.期末基金资产净值			70,026,959.00
5.期末基金份额净值			1.0000

注:注:本基金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)扣除相应费用后的余额,本期利润即为实现收益加上本期公允价值变动收益。

注:注:本基金已实现收益以现金形式存入本基金,本期利润即为本期公允价值变动收益。

注:注:本基金利润以现金形式存入,投资人收益以现金形式存入,基金净值以现金形式存入。

注:注:本基金利润以现金形式存入,投资人收益以现金形式存入,基金净值以现金形式存入。