（上接D30版）

10、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：权唐
电话：010-85130588
传真：010-65182261
客户服务电话：4008888108
网址：http://www.csc108.com
11、中信证券股份有限公司
注册地址：深圳市深南路7088号招商银行大厦A层
办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-84588888
传真：010-84865560
客户服务电话：010-84588888
网址：http://www.cs.ecitic.com
（5）基金验资机构
机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法人代表：杨绍信
电话：021-61238888
传真：021-61238800
联系人：张鸿
经办注册会计师：汪棣、张鸿

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用
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。
（二）基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
（三）基金资产负债表
本基金截至2012年5月4日的资产负债表如下：

资产	本报告期末 2012年5月4日
资产：	
银行存款	154,568,125.75
结算备付金	7,856,313.01
存出保证金	-
交易性金融资产	797,250,570.94
其中：股票投资	797,250,570.94
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	50,000,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	128,416.19
应收股利	115,648.93
应收申购款	-
其他资产	245,255.04
资产总计	1,010,164,329.86
负债和所有者权益	本报告期末 2012年5月4日
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	55,513,154.53
应付赎回款	
应付管理人报酬	51,194.67
应付托管费	10,238.93
应付销售服务费	-
应付交易费用	476,891.74
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	45,897.89
负债合计	56,097,377.76
所有者权益：	
实收基金	910,258,387.00
未分配利润	43,808,565.10
所有者权益合计	954,066,952.10
负债和所有者权益总计	1,010,164,329.86

注：1、截至2012年5月4日，基金份额净值1.0481元，基金份额总额910,258,387.00份。
2、本报告期自2012年4月10日起至2012年5月4日止。本基金自同于2012年4月10日生效，截至本报告期未本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

（一）基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	797,250,570.94	78.92
	其中：股票	797,250,570.94	78.92
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	4.95
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	162,424,438.76	16.08
6	其他各项资产	489,320.16	0.05
7	合计	1,010,164,329.86	100.00

（二）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	19,880,306.79	2.08
B	采掘业	554,180,094.46	58.09
C	制造业	215,339,760.99	22.57
C0	食品、饮料	18,979,398.92	1.99
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,758,891.32	0.60
C5	电子	2,913,467.00	0.31
C6	金属、非金属	187,688,003.75	19.67
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	7,850,408.70	0.82
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	797,250,570.94	83.56

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600111	包钢稀土	1,075,804	45,162,251.92	4.73
2	601857	中国石油	3,856,400	38,872,512.00	4.07
3	601899	紫金矿业	8,475,600	37,123,128.00	3.89
4	601088	中国神华	1,314,486	36,411,262.20	3.82
5	601699	潞安环能	1,225,344	35,645,256.96	3.74
6	600547	山东黄金	945,648	34,156,805.76	3.58
7	600028	中国石化	4,688,000	34,081,760.00	3.57
8	600348	阳泉煤业	1,599,549	33,526,547.04	3.51
9	600489	中金黄金	1,305,805	30,555,837.00	3.20
10	600362	江西铜业	1,103,585	30,403,766.75	3.19

（四）按券种分类的债券投资组合
截至2012年5月4日，本基金未持有债券。
（五）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细
截至2012年5月4日，本基金未持有债券。
（六）投资组合报告附注
1、自基金合同生效日至2012年5月4日，本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
2、本基金前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3、其他各项资产构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	115,648.93
4	应收利息	128,416.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	245,255.04
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	489,320.16

4、权证投资情况
截至2012年5月4日，本基金未持有权证；自基金合同生效日至2012年5月4日，本基金未投资任何权证。
5、本报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2012年5月4日，本基金未持有可转换债券。
6、本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细
截至2012年5月4日，本基金未持有资产支持证券。
7、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。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至本公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。
（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为中银万国证券股份有限公司。上市推荐人与本基金管理人、基金托管人之间不存在任何关联关系。
上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：
1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；
2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回的场所
投资人应当在申购赎回代理券商的营业场所按申购赎回代理券商提供的方式办理基金的申购和赎回。
目前，基金申购、赎回代办证券公司（一级交易商）包括东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、天源证券经纪有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司等11家证券公司。
（二）申购与赎回办理的开放日及时间
1、申购、赎回的开始时间
自2012年5月11日起，本基金开始办理申购、赎回业务。
2、开放日及开放时间
投资人可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日，开放时间为上午9:30-11:30和下午13:00-15:00。在此时间之外不办理基金份额的申购、赎回。具体以销售网点的公告和安排为准。
若上海证券交易所变更交易时间或出现其他特殊情况，基金管理人可对开放日、开放时间进行相应的调整并公告。
（三）申购与赎回的原则
1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购、赎回均以份额申请。
2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
3、申购、赎回申请提交后不得撤销。
4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》的规定。
5、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人最迟须于新规则开始实施日前2日在中国证监会指定的信息披露媒体公告。
（四）申购与赎回的程序
1、申购和赎回申请的提出
投资人须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。
投资人申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金。投资人提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金。
2、申购和赎回申请的确认
基金投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。
3、申购和赎回的清算交收与登记
投资人T日申购、赎回成功后，登记机构在T日收市后为投资人办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在T+1日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。
登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的3个工作日前在中国证监会指定的信息披露媒体公告。
（五）申购与赎回的数量限制
投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。
本基金的最小申购赎回单位为100万份，基金管理人有权对其进行调整，并在调整实施2日前于中国证监会指定的信息披露媒体公告。
（六）申购与赎回的对价和费用
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。
（七）申购赎回清单的内容与格式
1、申购赎回清单的内容
T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日的现金差额、基金份额净值及其他相关内容。
2、组合证券相关内容
组合证券是指本基金和的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告基金最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。
3、现金替代相关内容
现金替代是指申购、赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书规定的原则，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。
现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。
禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。
可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。
必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。
①关于可以现金替代
1）适用情形：出于证券停牌等原因导致投资人无法在申购时买入证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。
2）替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：
替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例）
其中，“参考价格”的确定原则包括但不限于：
①　该证券正常交易时，采用最新成交价。
②　该证券正常交易中出现涨停/跌停时，采用涨停/跌停价格。
③　该证券停牌且当日有成交时，采用最新成交价。
④　该证券停牌且当日无成交时，采用前收盘价（考虑当日的除权除息等因素）。
如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。
参考基金份额净值目前为最新基金份额参考净值，如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。
收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在该部分证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金买入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金买入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。
3）替代金额的处理程序如下：
T日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。
在T日后被替代的部分证券有正常交易的2个交易日（即T+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。
T+2日日终，若基金管理人已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际买入成本（包括买入价格和交易费用）的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若基金管理人未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券的实际买入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。
特殊情况：若自T日起，上海证券交易所正常交易日已达20日而该部分证券的正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券的实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。
若现金替代日（T日）后至T+2日（在特殊情况下则为T日起的第20个正常交易日）期间被替代的证券发生除息、送股（转增）、配股，以及由于股权分置改革等发生的其他权益变动，则进行相应调整。
T+2日后的第1个市场交易日（在特殊情况下则为T日起的第21个市场交易日），基金管理人将应退款和应补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收，将于此后3个工作日内完成。
4）替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资人使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

公式中，“参考价格”的确定原则与可以现金替代情况下，替代金额的计算公式中的该证券参考价格确定原则相同。参考基金份额净值目前为最新基金份额参考净值，如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。
②关于必须现金替代
1）适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整将被剔除的成份证券，或出于保护基金持有人利益等目的基金管理人认为有必要实行必须现金替代的成份证券。
2）替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其T日预估开盘价。
4、预估现金部分相关内容
预估现金部分是指，为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资人的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。
T日申购赎回清单中公告T日预估现金部分，其计算公式为：
T日预估现金部分=T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值-（申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额总额+申购赎回清单中可以用现金替代的所有成份证券的数量与其T日预估开盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代的所有成份证券的数量与其T日预估开盘价乘积之和）
其中，T日预估开盘价是对标的指数成份证券预估的开盘价。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值”需要扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。
5、现金差额相关内容
T日现金差额在T+1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：
T日现金差额=T日最小申购赎回单位的基金资产净值-（申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额总额+申购赎回清单中可以用现金替代的所有成份证券的数量与其T日收盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代的所有成份证券的数量与其T日收盘价乘积之和）
T日投资人申购、赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行收付的清算交收。现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资人申购时，如现金差额为正数，则投资人应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资人赎回时，如现金差额为正数，则投资人将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。
6、申购赎回清单的格式

表：T日申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息	
最新公告日期	2012-5-4
基金名称	上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	博时基金管理有限公司
一级市场基金代码	510411
T-1日信息内容	
现金差额（单位：元）	0
最小申购赎回单位资产净值（单位：元）	1,040,582.22
基金份额净值（单位：元）	1.0406
T日信息内容	
预估现金部分（单位：元）	161.22
可以现金替代比例上限	0.4
是否需要公布IOPV	是
最小申购赎回单位（单位：份）	1,000,000
申购、赎回的允许情况	允许

T日成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢比价率	固定替代金额
600028	中国石化	5900	允许	10%	
600087	*ST长油	2800	允许	10%	
600108	亚盛集团	2300	允许	10%	
600111	包钢稀土	2300	允许	10%	
600121	郑州煤电	500	允许	10%	
600123	兰花科创	600	允许	10%	
600139	西部资源	600	允许	10%	
600188	兖州煤业	1000	允许	10%	
600219	南山铝业	2000	允许	10%	
600251	冠农股份	300	允许	10%	
600255	鑫科材料	600	允许	10%	
600259	广晟有色	200	允许	10%	
600311	荣华实业	1100	允许	10%	
600331	宏达股份	1400	允许	10%	
600348	阳泉煤业	2000	允许	10%	
600362	江西铜业	1400	允许	10%	
600387	海越股份	500	允许	10%	
600395	盘江股份	600	允许	10%	
600432	吉恩镍业	700	允许	10%	
600456	宝钛股份	400	允许	10%	
600489	中金黄金	1700	允许	10%	
600497	驰宏锌锗	1100	允许	10%	
600508	上海能源	500	允许	10%	
600516	方大炭素	1100	允许	10%	
600531	豫光金铅	300	允许	10%	
600547	山东黄金	1200	允许	10%	
600549	厦门钨业	500	允许	10%	
600583	海油工程	3300	允许	10%	
600595	中孚实业	1300	允许	10%	
600598	北大荒	1200	允许	10%	
600673	东阳光铝	400	允许	10%	
600737	中粮屯河	800	允许	10%	
600740	山西焦化	700	允许	10%	
600888	新疆众和	300	允许	10%	
600961	株冶集团	400	允许	10%	
600971	恒源煤电	500	允许	10%	
600997	开滦股份	1000	允许	10%	
601001	大同煤业	1100	允许	10%	
601088	中国神华	1700	允许	10%	
601101	昊华能源	700	允许	10%	
601168	西部矿业	3200	允许	10%	
601600	中国铝业	4900	允许	10%	
601666	平煤股份	2000	允许	10%	
601699	潞安环能	1600	允许	10%	
601808	中海油服	1000	允许	10%	
601857	中国石油	4200	允许	10%	
601898	中煤能源	3100	允许	10%	
601899	紫金矿业	10700	允许	10%	
601918	国投新集	900	允许	10%	
601958	金钼股份	1600	允许	10%	

来源：博时基金
（八）拒绝或暂停申购的情形
在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：
1、因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法接受投资人的申购申请；
2、证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
3、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构因异常情况无法办理申购；
4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
5、基金管理人有正当理由认为接受某笔或某批申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；
6、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上述1、2、3、4项情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应根据有关规定在指定媒体及基金管理人网站上刊登暂停申购公告。
在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。
（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：
1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
2、证券交易场所在交易时间内临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
3、上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记机构因异常情况无法办理赎回；
4、发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况；
5、法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上述情形且基金管理人决定暂停赎回时，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案并予以公告。
在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。
（十）基金申购与其他服务
在条件允许时，基金管理人可开放集合申购业务，即允许多个投资人集合其持有的组合证券共同构成最小申购赎回单位或其整数倍进行申购。
基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和基金合同的规定开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

十四、备查文件目录

（一）中国证监会核准上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
（二）《上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
（三）《上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
（四）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（五）基金托管人业务资格批件、营业执照；
（六）关于申请募集上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书。
风险提示：本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将来表现。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

博时基金管理有限公司
2012年5月8日

附件：基金合同摘要

第一部分　基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金管理人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：
1、自本基金合同生效日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用并管理基金财产；
2、依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
3、发售基金份额；
4、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
5、在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管及非交易过户等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
6、根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
7、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
8、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
9、自行担任或选择、更换登记机构，获取基金份额持有人名册，并对登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
10、选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
11、选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
12、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
13、依法召集基金份额持有人大会；
14、法律法规和基金合同规定的其他权利。
（二）基金管理人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：
1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2、办理基金备案手续；
3、自基金合同生效日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7、依法接受基金托管人的监督；
8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价；
9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；
10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资人申购的份额或赎回的股票、现金替代金额及现金差额；
11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12、编制中期和年度基金报告；
13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
24、执行生效的基金份额持有人大会决议；
25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。
（三）基金托管人的权利
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：
1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
2、办理基金备案手续；
3、自基金合同生效日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
7、依法接受基金托管人的监督；
8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价；
9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；
10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付投资人申购的份额或赎回的股票、现金替代金额及现金差额；
11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
12、编制中期和年度基金报告；
13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
18、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
24、执行生效的基金份额持有人大会决议；
25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。
（四）基金托管人的义务
根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：
1、安全保管基金财产；
2、设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
3、对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
8、对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
9、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
10、按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
11、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
12、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格；
13、按照规定监督基金管理人的投资运作；
14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
15、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
16、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
17、因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
18、基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；
19、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
20、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，