

博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2013 第四季度 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:2014年1月22日

6.1 重要提示

基金管理人、基金托管人及相关信息披露义务人承诺,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。
基金管理人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月21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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。
基金的过往业绩并不预示其未来业绩,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。
本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

6.2 基金产品概况

基金简称	博时上证自然资源ETF联接
基金代码	050024
交易代码	050024
基金运作方式	交易型开放式指数基金的联接基金
基金合同生效日	2012年4月10日
报告期末基金份额总额	63,806,563.12份

投资目标 跟踪主要指数上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数即上证自然资源指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

投资策略 本基金主要投资于上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金,方便特定的客户群体通过本基金投资于上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金,本基金不参与上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金的投资管理。

业绩比较基准 上证自然资源指数收益率×90%+银行活期存款利率×10%

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。

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

2.1.1 基金基本情况

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10日

上市交易所 上海证券交易所

基金管理人名称 博时基金管理有限公司

基金托管人名称 中国建设银行股份有限公司

2.1.2 基金产品概况

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。

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组合化投资组合,并跟踪标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,但跟踪标的指数成份股的过程中,本基金将根据基金资产净值和跟踪标的指数的表现,适当调整投资组合,以期达到跟踪标的指数的目的。

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。该指数成份股包括:

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。

3.1 主要投资指标

主要财务指标 单位:人民币元

1.本期已实现收益 报告期(2013年10月1日至2013年12月31日) -2,718,618.16

2.本期利润 -5,767,337.28

3.加权平均基金份额本期利润 -0.067

4.期末基金资产净值 50,311,410.15

5.期末基金份额总额 60,603

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。

1.2 基金净值表现 本基金净值表现不包括持有人认购及交易基金的各项费用,计入费用后投资的实际收益水平要低于所列数字。

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表现的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益③ 业绩比较基准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -10.27% 1.00% -0.78% 1.00% -0.49% 0.00%

3.2.2 本基金合同成立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变动的比较

注:本基金的基金合同于2012年4月10日生效,按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二条“(二)投资组合”、“(九)投资限制”的有关规定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

6.4 管理人报告

4.1 基金运作(或基金经理)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理年限 证券从业年限 说明

方维珍 基金经理 2013-9-13 - 21.5 曾任先后在云南大学、海南省信托投资公司证券部、博时证券有限责任公司公募部门负责基金、北京量子软件技术有限公司(即:2001年3月1日博时基金管理有限公司前身)、中信基金、中国基金网、数量化投资部副经理、产品规划部副经理、股票投资部ETF及量化投资组合经理、博时上证自然资源ETF基金及其联接基金和上证自然资源ETF基金及其联接基金的基金经理助理,现任博时上证自然资源ETF基金及其联接基金的基金经理。

4.2 管理人及报告期内基金运作遵规守信情况的说明

4.3 基金管理人内部控制制度的说明

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.5 报告期内基金业绩比较基准的表现

4.6 报告期内基金投资组合的表现说明

4.7 报告期内基金投资组合的表现说明

4.8 报告期内基金投资组合的表现说明

4.9 报告期内基金投资组合的表现说明

4.10 报告期内基金投资组合的表现说明

4.11 报告期内基金投资组合的表现说明

4.12 报告期内基金投资组合的表现说明

4.13 报告期内基金投资组合的表现说明

4.14 报告期内基金投资组合的表现说明

4.15 报告期内基金投资组合的表现说明

4.16 报告期内基金投资组合的表现说明

4.17 报告期内基金投资组合的表现说明

4.18 报告期内基金投资组合的表现说明

4.19 报告期内基金投资组合的表现说明

4.20 报告期内基金投资组合的表现说明

4.21 报告期内基金投资组合的表现说明

4.22 报告期内基金投资组合的表现说明

4.23 报告期内基金投资组合的表现说明

4.24 报告期内基金投资组合的表现说明

4.25 报告期内基金投资组合的表现说明

4.26 报告期内基金投资组合的表现说明

4.27 报告期内基金投资组合的表现说明

4.28 报告期内基金投资组合的表现说明

4.29 报告期内基金投资组合的表现说明

4.30 报告期内基金投资组合的表现说明

4.31 报告期内基金投资组合的表现说明

4.32 报告期内基金投资组合的表现说明

4.33 报告期内基金投资组合的表现说明

4.34 报告期内基金投资组合的表现说明

4.35 报告期内基金投资组合的表现说明

4.36 报告期内基金投资组合的表现说明

4.37 报告期内基金投资组合的表现说明

4.38 报告期内基金投资组合的表现说明

4.39 报告期内基金投资组合的表现说明

4.40 报告期内基金投资组合的表现说明

4.41 报告期内基金投资组合的表现说明

4.42 报告期内基金投资组合的表现说明

4.43 报告期内基金投资组合的表现说明

4.44 报告期内基金投资组合的表现说明

4.45 报告期内基金投资组合的表现说明

4.46 报告期内基金投资组合的表现说明

4.47 报告期内基金投资组合的表现说明

4.48 报告期内基金投资组合的表现说明

4.49 报告期内基金投资组合的表现说明

4.50 报告期内基金投资组合的表现说明

4.51 报告期内基金投资组合的表现说明

4.52 报告期内基金投资组合的表现说明

4.53 报告期内基金投资组合的表现说明

4.54 报告期内基金投资组合的表现说明

4.55 报告期内基金投资组合的表现说明

4.56 报告期内基金投资组合的表现说明

4.57 报告期内基金投资组合的表现说明

4.58 报告期内基金投资组合的表现说明

4.59 报告期内基金投资组合的表现说明

4.60 报告期内基金投资组合的表现说明

4.61 报告期内基金投资组合的表现说明

4.62 报告期内基金投资组合的表现说明

4.63 报告期内基金投资组合的表现说明

4.64 报告期内基金投资组合的表现说明

4.65 报告期内基金投资组合的表现说明

4.66 报告期内基金投资组合的表现说明

4.67 报告期内基金投资组合的表现说明

4.68 报告期内基金投资组合的表现说明

4.69 报告期内基金投资组合的表现说明

4.70 报告期内基金投资组合的表现说明

4.71 报告期内基金投资组合的表现说明

4.72 报告期内基金投资组合的表现说明

4.73 报告期内基金投资组合的表现说明

4.74 报告期内基金投资组合的表现说明

4.75 报告期内基金投资组合的表现说明

4.76 报告期内基金投资组合的表现说明

4.77 报告期内基金投资组合的表现说明

4.78 报告期内基金投资组合的表现说明

4.79 报告期内基金投资组合的表现说明

4.80 报告期内基金投资组合的表现说明

4.81 报告期内基金投资组合的表现说明

4.82 报告期内基金投资组合的表现说明

4.83 报告期内基金投资组合的表现说明

4.84 报告期内基金投资组合的表现说明

4.85 报告期内基金投资组合的表现说明

4.86 报告期内基金投资组合的表现说明

4.87 报告期内基金投资组合的表现说明

4.88 报告期内基金投资组合的表现说明

4.89 报告期内基金投资组合的表现说明

4.90 报告期内基金投资组合的表现说明

4.91 报告期内基金投资组合的表现说明

4.92 报告期内基金投资组合的表现说明

4.93 报告期内基金投资组合的表现说明

4.94 报告期内基金投资组合的表现说明

4.95 报告期内基金投资组合的表现说明

4.96 报告期内基金投资组合的表现说明

4.97 报告期内基金投资组合的表现说明

4.98 报告期内基金投资组合的表现说明

4.99 报告期内基金投资组合的表现说明

4.100 报告期内基金投资组合的表现说明

4.101 报告期内基金投资组合的表现说明

4.102 报告期内基金投资组合的表现说明

4.103 报告期内基金投资组合的表现说明

4.104 报告期内基金投资组合的表现说明

4.105 报告期内基金投资组合的表现说明

4.106 报告期内基金投资组合的表现说明

4.107 报告期内基金投资组合的表现说明

4.108 报告期内基金投资组合的表现说明

4.109 报告期内基金投资组合的表现说明

4.110 报告期内基金投资组合的表现说明

4.111 报告期内基金投资组合的表现说明

4.112 报告期内基金投资组合的表现说明

4.113 报告期内基金投资组合的表现说明

4.114 报告期内基金投资组合的表现说明

4.115 报告期内基金投资组合的表现说明

4.116 报告期内基金投资组合的表现说明

4.117 报告期内基金投资组合的表现说明

4.118 报告期内基金投资组合的表现说明

4.119 报告期内基金投资组合的表现说明

4.120 报告期内基金投资组合的表现说明

4.121 报告期内基金投资组合的表现说明

4.122 报告期内基金投资组合的表现说明

4.123 报告期内基金投资组合的表现说明

4.124 报告期内基金投资组合的表现说明

4.125 报告期内基金投资组合的表现说明

4.126 报告期内基金投资组合的表现说明

4.127 报告期内基金投资组合的表现说明

4.128 报告期内基金投资组合的表现说明

4.129 报告期内基金投资组合的表现说明

4.130 报告期内基金投资组合的表现说明

4.131 报告期内基金投资组合的表现说明

4.132 报告期内基金投资组合的表现说明

4.133 报告期内基金投资组合的表现说明

4.134 报告期内基金投资组合的表现说明

4.135 报告期内基金投资组合的表现说明

4.136 报告期内基金投资组合的表现说明

4.137 报告期内基金投资组合的表现说明

4.138 报告期内基金投资组合的表现说明

4.139 报告期内基金投资组合的表现说明

4.140 报告期内基金投资组合的表现说明

4.141 报告期内基金投资组合的表现说明

4.142 报告期内基金投资组合的表现说明

4.143 报告期内基金投资组合的表现说明

4.144 报告期内基金投资组合的表现说明

4.145 报告期内基金投资组合的表现说明

4.146 报告期内基金投资组合的表现说明

4.147 报告期内基金投资组合的表现说明

4.148 报告期内基金投资组合的表现说明

4.149 报告期内基金投资组合的表现说明

4.150 报告期内基金投资组合的表现说明

4.151 报告期内基金投资组合的表现说明

4.152 报告期内基金投资组合的表现说明

4.153 报告期内基金投资组合的表现说明

4.154 报告期内基金投资组合的表现说明

4.155 报告期内基金投资组合的表现说明

4.156 报告期内基金投资组合的表现说明

4.157 报告期内基金投资组合的表现说明

4.158 报告期内基金投资组合的表现说明

4.159 报告期内基金投资组合的表现说明

4.160 报告期内基金投资组合的表现说明

4.161 报告期内基金投资组合的表现说明

4.162 报告期内基金投资组合的表现说明

4.163 报告期内基金投资组合的表现说明

4.164 报告期内基金投资组合的表现说明

4.165 报告期内基金投资组合的表现说明

4.166 报告期内基金投资组合的表现说明

4.167 报告期内基金投资组合的表现说明

4.168 报告期内基金投资组合的表现说明

4.169 报告期内基金投资组合的表现说明

4.170 报告期内基金投资组合的表现说明

4.171 报告期内基金投资组合的表现说明

4.172 报告期内基金投资组合的表现说明