

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摘要

二、主要人员情况。 1. 基金管理人預學表成門 於獨女士。由生,獲事长,深圳市五届人大代表,中国红十字会第九届理事会常务理事。1983年起历任中国银行国际金融 新衛女士。由生,獲事长,深圳市五届人大代表,中国红十字会第九届理事会常务理事。1983年起历任中国银行国际金融 基金管理公司副总理,中信基金管理公司总是理,相商银行业等都总是理,表现中大投资管理公司总等,总裁。2008年,长盛 推荐基金管理公司副总理,中信基金管理公司总是理,相商银行业或事,招商证券股份有限公司董事,德裁、2008年,总 建市,建市资本管理有限公司董事长,建任公司董事长,兼任招商证券股份有限公司董事、博时基金(国际)有限公司董事会 主席、博时资本管理有限公司董事长。

主席、博村资本管理有限公司董事长。 泰自国先生,博士后,随来年长,1993年起历任山东证券投资银行部副总经理、制总经理、泰安营业部副总经理、中经信投 资公司总经理助理、中经证券有限公司董事长,1993年起历任山东证券投资银行部副总经理、制总经理、中国中海被广营建公司投资事业 都总经理助理,中经证券有限公司筹备组组长、水汇信用租赁有限公司董事长。经定理,中国中海被广营建公司投资事业 或总经理助理,中经证券有限公司董事会董事、2011年1月,近代管理公司该事长会遗址,这些理、2011年7月成。任 财基金管理有限公司董事会董事、2011年7月成。任博时基金管理有股公司董事会副董事长。 吴姚东先生,博士、北京大学光学管理学校医BMA、董事、2022年进入招管业务股份有限公司,历任国际业务部分析师、招 而证券或汉营业部总经理、招前证券(资格)公司总经理、董事、博时基金(国际、有限公司、历任国际业务部分析师、招 加工等5月加入时制基金管理保险公司,提任公司总经理、董事、博时基金(国际、有限公司董事会副主席张总统、博村资本管 建有限公司副董事任张总经理。

具城东先生。简历同上, 丰德东生生。而七、副总经理。1995年起先后在北京清华计算机公司任开发都经理,清华紫光股份公司CAD与信息事业部 2.1 超師。2000年加入博林基金管理有限公司,历任行政管理部局经理,电脑部局经理,信息技术都总经理。现任公司副总 里,兼任博林基金(国际)有限公司董事,博封资本管理有限公司董事。 董段宏先生、CPA、MBA、副总经理。1993年起先后在中国技术进出口总公司,中技上海投资公司、融通基金管理有限公司、 基金管理有限公司从事投资管理上,2005年2月加、博司基金管理有限公司,历任社保股票基金经理,特定资产高级投 课。例实部总是建集特定资产高级投资经理,社保股票基金经理,特定资产管理的总经理。现任公司副总经理基本高级投资 里。社保银合投资经理,推任博时基金(国际)有限公司董事,博封安本管理有限公司董事。 是,社保银合投资经理,推任博时基金(国际)有限公司董事,博封安本管理有限公司董事。 李志思先生、经济学博士,副总经理,1993年7月起先后在深圳市住宅局房设、规圳市委政策研究室城市研究处,深圳市 定保研究室综合处工作。2004年9月加入博时基金管理有限公司,历任行政与人力资源部副总经理。总裁办公室总经理莱莱 该书、机构业务者事总经理,现任公司副总经理

事会秘书。机构业务董市总经理。现任公司副总经理。 邵凯先生、经济学硕士、副总经理。1997年至1999年在河北省经济开发投资公司从事投资管理工作。2000年8月加入博封 基金管理有限公司、历任佛等组合经理助理、佛券组合经理、社保债券基金基金经理、固定收益部副总经理兼社保债券基金基 金经理、固定收益部总经理、固定收益投资总监。现任公司副总经理兼社保组合投资经理、兼任博时基金(国际)有限公司董 事、博明资本管理有限公司董等

曾先后在云南大学、海南省信托投资公司证券部、湘财证券有限责任公司海口营业部、北京玖方量子 1年3月人博时基金管理有限公司、历任金融工程小组金融工程师、数量化投资部副总经理、产品规划

理:胡俊敏女士,2012年4月10日至2013年9月12日任本基金基金经理。 カ仕森玉年年: 四10.5 m ス ユ , エ ハ 央策委员会成员 3 w 东 - 董良泓、邵凯、邓晓峰、黄健斌、魏风春、聂挺进。

限公司,历任基金经理助理,特定资产管理部局总经理,股票投资部价值租投资制总证,现任权益投资总部高等。总经理兼股票投资部总证。现代权益投资总部高等。总经理兼股票投资部总证。现代权益投资总部高等。总经理兼股票货资部总定。 现代政治设计。 1954年 19

第二部分 基金托管人 1.基本情况 名称,中国建设银行股份有限公司(简称,中国建设银行) 住所,北京市西域区金融大街25号 办公地址,北京市西域区闽市口大街1号院1号楼 法定代表人,王洪章

法定代表人; 主典單 成立时间; 2004年09月17日 组织形式; 股份有限公司 注册资本; 贰仟伍佰亿壹仟零玖拾垛万垛仟肆佰捌拾陆元整 字续期间:持续经营 基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号

(上接 B42 版) 本基金在充分考虑个股内在价值和风险收益水平的基础上,在二级股票池中选取个股构建基金的股票组合。运用组合优化模型不断优化股票组合,以达到单位风险下的收益最大化。

(三)债券资产投资策略 本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方 向及收益率曲线分析,通过债券置换和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。 当预测收益率曲线平行上移或是陡峭化时,适当地降低债券组合的平均久期;当预测收益率曲

我平了下移或是平组化时,适当地增加债券组合的中域,到一种规则外组已过一分人则,当现的收益十年, 我平了下移或是平组化时,适当地增加债券组合的持仓量;当预测收益率曲线剧烈平行下移时,同时增加债 时降低债券组合的平均久期和债券组合的持仓量;当预测收益率曲线剧烈平行下移时,同时增加债 券组合的平均久期和债券组合的持仓量;当预测收益率曲线(正向或是反向)蝴蝶型变化时,适当地 将债券组合进行子弹型或是哑铃型配置。 2、债券置换策略

本基金以利差分析为基础,当债券利差增大时,适当增加企业债和金融债的数量、减少国债的数 一个基金及中区力划为金融,当成分中区有人中,是当有加止亚顶性金融项的效量、减少国顶的效量、减少企业债和金融债的数量、债券组合的平均信用等级保持在投资级(A+级)以上。 在通过上述配置方法构建债券组合之后,本基金在出现以下情况时对债券投资组合进行动态调

(1) 短期经济运行指标,如短期通货膨胀率、短期名义利率、汇率等发生变动,引起的市场实际利

(2) 中长期国内通货膨胀预期的变动引起中长期利率走势变动,导致整个投资组合重新估价; (3) 央行通过公开市场操作引导市场收益率水平的走向,从而引起债券市场结构性调整; (4) 债券一级市场上的发行方式创新及新债定价与申购情况发生变化,导致二级市场收益率产

(5) 由于市场交易规则改变等因素引起的流动风险溢价的重新估价; (6) 市场平均风险偏好的变化引起信用风险溢价的变动;

单个券种或某一类别债券的定价偏差,也就是市场失衡导致的投资机会等。

业绩比较基准:65%上证综合指数收益率+35%上证国债指数收益率

上证综合指数以上海证券交易所上市所有股票为样本,大部分为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,基本能够反映 A 股市场发展趋势。该指数具有较强的公正性与权威性、市场代表性较强;上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加 。上证国债指数是上证指数系列的第一只债券指数,反映我国债券市场整体变动状况,具有较 场代表性。 在本基金的运作过程中,如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更

符合基金份额持有人的利益,则基金管理人在经过基金托管人同意后可以对业绩比较基准进行适当调整,并在报中国证监会核准后、公告并予以实施。 第十节 风险收益特征

具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。 第十一节 基金投资组合报告

第十一日 查班及项组占报告 本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,于 2014年4月17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

本投资组合报告所载数据截止2014年3月31日,本报告所列财务数据未经审计。 一)报告期末基金资产组合情况 2,183,534,230.5 158,628,262.79 109,980,364.97 4.14

观化的内程上年末度。
2.主要人情情况
2.主要人情情况
2.主要人情情况
4. 新斯· 投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行正常省分行,广东省分行,中国建设银行总行会计部、营运管理
形、新斯· 共及抗任党业务部总经理,曾就职于中国建设银行商通分行,中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业
纪书· 投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行商通分行,中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业
宏、民国、特大学户的学生管理及投资工作。具有丰富的客户服务和业务管理经验。
"张军红、投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行商通分行,中国建设银行营与各市、个银行业务部、行长
公室、长别从事等商业务和制总经理,曾被职于中国建设银行商场分行,中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、分公室、长别从事等商业务和一人存成业务管理等中,且具有主动。是有一个企业,在一个企业,有一个企业,有一个企业,有一个企业,有一个企业,有一个企业,在一个企业,有一个企业,在一

	简称"一级交易商")	
(1)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/	
(2)国信证券股份有限: 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: 电话:	齐晓燕 0755-82130833	
传真:	0755-82133952	
客户服务电话:	95536	
网址: (3)招商证券股份有限:	http://www.guosen.com.cn/	
(3)拍向证券放切有限: 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:	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层	
が公地址: 法定代表人:	官少林	
联系人:	林生迎	
財系人: 电话:	0755-82960223	
传真:	0755-82943636	
客户服务电话:	4008888111;95565	
网址: (4)中信证券股份有限:	http://www.newone.com.cn/	
(4)平信证券放切有限: 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	
^{屯店:}	010-84865560	
客户服务电话:		
	010-84588888	
网址: (5)中国银河证券股份:	http://www.es.ecitic.com/	
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:	陈有安	
联系人:	田薇	
电话:	010–66568430	
传真:	010-66568990	
客户服务电话:	400888888	
网址 :	http://www.chinastock.com.en/	
(6)海通证券股份有限:		
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:	王开国	
联系人:	金芸、李笑鸣	
电话:	021-23219275	
传真:	021-63602722	
客户服务电话:	95553	
网址:	http://www.htsec.com/	
(7)申银万国证券股份:		
注册地址:	上海市常熟路171号	
办公地址:	上海市常熟路171号	
法定代表人:	丁国荣	
联系人:	黄维琳、曹晔	
电话:	021–54033888	
传真:	021-54038844	
客户服务电话:	95523	
网址:	http://www.sywg.com/	
(8)中信证券(浙江)有		
注册地址:	浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层	
办公地址:	浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层	
法定代表人:	沈强	
联系人:	姚锋	
电话:	0571-86087713	
传真:	0571-85783771	
客户服务电话:	0571-95548	
网址:	http://www.bigsun.com.cn/	
(9)中信万通证券有限	责任公司	
注册地址:	青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层	
办公地址:	青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层	
法定代表人:	杨宝林	
联系人:	吴忠超	
电话:	0532-85022326	
传真:	0532-85022605	
	0532-85022605 0532-96577	

京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15

35,209,818.92

30,394,800.96

116,394,887.70

479,460,877.29

63,102,000.00

44,323,610.40

2,183,534,230.55 七小排序的

35,158,312.79

净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

54.86

4.51

18.59

1008888993

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

农、林、牧、渔

制造业

电力、热力、燃气及水生产和供应」

批发和零售』

交通运输、仓储和邮政

租赁和商务服务』

居民服务、修理和其他服务

文化、体育和娱乐』

)报告期末按债券品种分类的债券投资

企业短期融资

(五)报告期末按公允价值占基金资产 時 债券代码 债券名称

(六)报告期末按公允价值占基金资产产本基金本报告期末未持有资产支持证券 (七)报告期末按公允价值占基金资产产

本基金本报告期末未持有贵金属。

110015

传输、软件和信息

客户服务电话

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				
(12)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:	袁长洁				
联系人:	刘晨				
电话:	021-22169081				
传真:	021-22169134				
客户服务电话:	4008888788;95525				
网址:	http://www.ebscn.com/				
(13)天源证券有限公司					
注册地址:	青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼				
办公地址:	深圳市民田路新华保险大厦18楼				
法定代表人:	裴东平				
联系人:	关键				
电话:	0755-33331188				
传真:	0755-33329815				
客户服务电话:	4006543218				
网址:	http://www.tyzq.com.cn				
(14)华泰证券股份有限公司	Section of the sectio				
注册地址:	江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦				
办公地址:	江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦				
法定代表人:	吴万善				
联系人:	废晓芸				
电话:	025-84457777				
传真:	025-84579763				
客户服务电话:	95597				
网址:	http://www.htsc.com.cn/				
(15)长城证券有限责任公司 注册地址:	深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、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				
が公地址: 法定代表人:					
伝走八衣人: 联系人:	首耀华				
电话:	高峰				
电站: 传真:	0755-83516094				
下共: 客户服务电话:	0755-83516199 4006666888				
	http://new.cgws.com/				
	悔证券交易所会员资格的所有证券公司。 ⊭法规,变更,增减销售本基金的代理机构,并及时公告。				

至外任而会计师: 辟党、优兆杰 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

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;银导性陈达或重大遗漏,并对其内容的真实性,准确 性和实验性受用力。但原本等力和

性和完整性承担个别及准带责任。 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,保证取保存客不存在度限过载,误单性陈述或者重大遗漏。 本投资组合报告所载数据截至2014年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。 1. 据集期主基金会产组合模据

1、报告》	明末基金资产组合情况			
序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例 6%)	
1	权益投资 157,322,7		99.34	
	其中:股票	157,322,776.44	99.34	
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	买人返售金融资产	-	-	
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	_	-	
5	银行存款和结算备付金合计	1,042,664.51	0.66	
7	其他资产	1,332.30	0.00	
8	合计	158,366,773.25	100.00	
2报告期	末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 66)	
A	农、林、牧、渔业	5,096,491.88	3.22	
В	采矿业	102,073,823.81	64.57	
С	制造业	40,372,852.35	25.54	
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	2,601,060.86	1.65	
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-	
	15 mbatta det 61 m			

(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。 (九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

2、本基金投资股指期货的投资政策

信息传输、软件和信息技术服务

本基金本报告期未投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套 期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合 本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期

货的定价模型寻求其合理的估值水平。 本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨 慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。 (十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金投资国债期货的投资政策: 根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

(十一)投资组合报告附注

本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 年受到公开谴责、处罚的情况。

2、基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

	10347 13764					
序号		名称		金額(元)		
1	存出	存出保证金		731,727.22		
2	应收证	券清算款		164,503,835.33		
3	M.			=		
4	M.	应收利息		2,483,404.94		
5	应比	应收申购款 77,037.06		77,037.06		
6	其他	其他应收款		=		
7	待	待摊费用		=		
8		其他		=		
9		合计		167,796,004.55		
4、报	告期末持有的处于转	专股期的可转换债	券明细			
序号	债券代码 债券名称		公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)		
1	110015	石化转债	35,129,289.20 1.36			
2	128002	东华转债	29,023.59	0.00		
r +r-	生期士前上夕四两日	- 大大大済或四は	2014424410	•		

股票代码 股票名称 第十二节 基金的业绩 基金业绩截止日为 2013 年 12 月 31 日,并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪宁职守、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

則应付细阅读本基金的招募说明书。						
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 率③	业绩比较基准收 益率标准差④	1)-(3)	(2)-(
007年4月11日至2007年12 月31日	58.30%	1.69%	32.70%	1.41%	25.60%	0.28
2008年度	-53.83%	2.33%	-47.00%	1.84%	-6.83%	0.49
2009年度	84.39%	1.48%	48.51%	1.23%	35.88%	0.25
2010年度	10.11%	1.22%	-8.02%	0.92%	18.13%	0.30
2011年度	-23.76%	0.93%	-13.17%	0.75%	-10.59%	0.18
2012年度	-5.06%	0.96%	3.57%	0.71%	-8.63%	0.25
2013年度	29.66%	1.25%	-3.18%	0.75%	32.84%	0.50
007年4月11日至2013年12 月31日	39.28%	1.48%	-16.34%	1.15%	55.62%	0.33

第十三节 基金的费用与税收 ·、基金费用的种类

卫生和社会工作		-		-			
文化、体育和娱乐业		-		-			
综合		7,178,547.54		4.54			
合计		157,322,776.44		99.52			
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				
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 %)			
600028	中国石化	1,928,524	9,700,475.72	6.14			
601857	中国石油	1,165,747	8,859,677.20	5.60			
601899	紫金矿业	3,679,744	8,279,424.00	5.24			
601088	中国神华	558,852	7,728,923.16	4.89			
600111	包钢稀土	362,778	7,262,815.56	4.59			
600256	广汇能源	979,338	7,178,547.54	4.54			
600583	海油工程	829,242	6,343,701.30	4.01			
600547	山东黄金	333,189	5,577,583.86	3.53			
600489	中金黄金	691,888	5,535,104.00	3.50			
600108	亚盛集团	731,204	5,096,491.88	3.22			
本报告期末未持有债。 用末按公允价值占基金 本报告期末未持有债。 用末按公允价值占基金 本报告期末未持有资。 用末按公允价值占基金 本报告期末未持有资。 再来按公允价值占基金	等。 资产净值比例大小排 等。 资产净值比例大小排 查支持证券。 资产净值比例大小排 金属。 资产净值比例大小排	序的前十名资产支持; 序的前五名贵金属投	正券投资明细				
	综合 合计 1束核公允价值占基金 股票代码 600028 601857 601889 601088 600111 600256 600583 600547 600489 600108 1來按債券品粹分案的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的 4次投资和未持有的	综合 合计 1束核公允价值占基金资产净值比例大小排 股票代码 股票名称 600028 中国石化 601857 中国石油 601857 中国石油 601859 紫金矿业 601088 中国神华 600111 包钢畅士 600526 广汇能源 600526 广汇能源 600547 山东黄金 600547 山东黄金 600489 中金黄金 600489 中金黄金 400188 亚黎州 1末核份事末未持有能等。 1末接份事末未持有能等。 1末接份事末未持有能等。 1末接份事本并有能等。 1末接份事本并有能等。 1末接公允价值占基金资产净值比例大小排 本报告期末未有资产净值比例大小排	综合 合计 1束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计 股票代码 股票名称 数量	综合 7,178,547.54 合计 157,322,776.44 13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判断 股票代码 股票名称 数量 62 公允价值 记) 600028 中国石化 1,928,524 9,700,475.72 601857 中国石油 1,165,747 8,859,677.20 601857 中国石油 3,679,744 8,279,424.00 601088 中国神华 558,852 7,728,923,16 600111 包部稀土 362,778 7,262,815,56 600256 广江能源 979,338 7,178,547.54 600583 海油工程 829,242 6,343,701,30 600547 山东黄金 333,189 5,577,583,86 600489 中金黄金 691,888 5,353,104,00 600108 亚盛集团 731,204 5,096,491,88 末枝倚寿品中分素的债券投资到给未投资财本未持有债券。 本报告则未未持有债券。 由报告处允允值占基金资产净值比例大小排序的前工名债券投资到细 本报告则未未持有资产支持证券。 在报告则未未持有资产支持证券。 在报告则未未持有资产支持证券。 在报告则未未持有资产支持证券。 在报告则未未持有资产支持证券。 在报告则未未持有资产支持证券。 在报告则未未持有资产均量在优例大小排序的前五名贵金强投资到细			

本盛並平权官別本不得有权证。 學 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以双型合报告附注 11.11本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体除中国石化(600028)外,没有出现被监管部门立案调查,或在报告 目前一年内受到公开谴责,处罚的情形。 中国石油化几股有限公司为2014年1月15日步布八步车。一 编制目前一年內交到公开證款、处切的情形。 中国石油化工股份有限公司2014年1月12日发布公告株。国务院对山东省青岛市"1122"中石化东黄输油管温泄漏爆炸 特別重大事故调查处理报告作出报复,问题国务院事故调查组的调查处理结果,以定是一起特别重大责任年故。同意对事故 有关责任华尼的两任人的处理建议,对中国不仅是当他政府的 48 名唐丘公为创修于汉律处为"边游粮至即"的 12 名劳任人

1,099.29

B 15 ロ ユハロがは スパペン和マロゴロブペス門の形作任民差。 基金管理人依照格尽职守、減次信用、議集勤勉的原則管理和返用基金 基金管理と維持下代支其未来表現、投資有政能、投資者在地租投資政策 自基金合同生效开始基金份額浄值增长半及其与同期业額比较基準收益 财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收 策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

2012/4/10-2012/12/31 2013/1/1-2013/12/31 -33.81% 1.49% -34.27% 1.50% 0.46% -46.28% 1.45% -44.1 第十三部分 基金费用概览 2012/4/10-2014/3/31 - 、与基金运作有关的费用

第十三部分 基金费用概览
(一)基金费用的种意
1.基金管则的特度
2.基金社管人的任管费
3.基金上市资处年费
4.基金的和效年费
4.基金的指效年费
5.基金收益价配度生的银行费用
6.基金收益价配度生的银行费用
7.基金合用业场问题基金有关的会计则费和律师费
10.基金的证券交易费用
11.证券账户户费用 银行账户维护费用
12.保法可以在基金财产均支的其他费用
(二)基金费用计量方法。计量标准和支付方式
1.基金管理人的管理费
在通常情况下,基金管理按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下;
HEAF管理费率—当年天数
1.与国人的管理费
E为前一日基金资产净值
基金社管费有日计模。按月专付。由基金管理人为基金社管费到付指令,经基金社管人复核后于次月首
起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遏法定节截日(休息日,支付日期顺延。
在通常情况下,基金管理费率,当年天数
用为每日日共成的主管费
在通常情况下,基金管理费等。19年天数
10.其金管理费等—19年天数
10.其金管理费率,19年天数
10.其金管理费率,19年天数
10.其金管理费率,19年发
10.其金管理费率,19年发
10.其金管理费率,19年发
10.其金管理费率,19年发
11.其金管产净值
基金社管费车日计提,接月支付。由基金管理人商品金社管人发送基金社管费到付指令,经基金社管负量基金社管费

费。在總常情况下、指数许可使用费桉前一目的基金资产净值的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: HEX-0.03%/当年天数 H方每日应付的销数许可使用费。E为前一日的基金资产净值 目基金合同生效之目息。基金标的指数许可使用费处等文化。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 访议的规定,指数许可使用费的收取下限分单等人民币59,000元(银不足59,000元能分处照59,000元成取)但基金合同生效 当季、指数许可使用费的收取下限分率多处出现整、本基金将采用调整后的方法或零半计算指数使用费。基金管理上应 如果报验许可使用费的指数许可使用费之法,约率发生调整、本基金将采用调整后的方法或零半计算指数使用费。基金管理上应 对解决的发展于信息费及报告可以表现许可使用费之外的基金费用,由基金托管人人排获地看一次的规定,按费用支 出金额支付、列入或模人当期基金费用,更分外的基金费用,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、列入或模人当期基金费用更全外的基金费用,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 二、与基金销售有关的费用 2、中期对价是指投资人申购基金价额的自由证券,现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资人联回 基金份额时,基金管理人应受付给帐回人的组合证券,现金替代、现金差额及其他对价。 2、申期对价。聚回对价根据申购,赎回清率和投资人申购,赎回商产业是自紧闭证券免房所并市市价价,应遇特殊情况,可以适当延 近计算或公告,并保中超证监金备案,申购,赎回商库也有是可以表面有有的合。如遇特殊情况,可以适当延 近计算或公告,并保中超证监金备案,申购,赎回商库均内容与格式设工业金档系统可

3、12以八任中网观账回盘並衍赖时,甲网顿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目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。

5.在"十一"基金的业绩"中,更新了"自基金台同生处开始基金份商准税末单"的数据及列表内容,数据内容截止时间 为2014年3月31日; 6.在"二十一"基金招管协议的内容摘要"中,对基金托管人的基本情况进行了更新; 7.在"二十三"其它应按廊的事项"中根据接受情况对相关应按废事项进行了更新; (1)2014年03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 投资盖金2013年年度指令[被引入] 投资金2013年4年程度的(第一年) 投资金2013年4年程度的(第一年) 10.2014年3月22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(大证自然资源交易型开放式指数证券 投资金2013年4年程度的(3) 10.2014年3月22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(关于博时上证自然资源至FF增加申购 联回公司。2014年3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(关于博时上证自然资源与基本目的公司是一个公司。2014年3月23日。

聚四代办业券公司的公告》。 (4) 2013年10 [22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2013年到季年度报告)。

(一)基金管理人的管理费; 一)其全托管人的托管费

三)基金财产拨划支付的银行费用; (四)基金合同生效后的信息披露费用。

(六)基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

(一)基金的证券交易费用; (八)在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方

(九)在于国证监会规定允许的制建了,华金3 计提标准在招募说明书或相关公告中载明; (九)依法可以在基金财产中列支的其他费用 、上述基金费用由基金管理人、基金托管人在法律规定的范围内按照公允的市场价格按实列

支,法律法规另有规定时从其规定 三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(一)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1.5%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3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 (二)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 0.25%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

基金托管费每日计程,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3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。 (三)除管理费和托管费之外的基金费用.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,列人或摊人当期基金费用。

四、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人基金费用。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。 五、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2日前在指定媒体上刊登公告 六、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

第十四节 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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券

投资基金销售管理方法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合不 基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对2013年11月23日刊登的本基金招募说明书进行了更 更新的主要内容如下: 1.在"重要提示"部分,更新了招募说明书内容的截止日期;

2、更新了"第三节 基金管理人"中的相关内容; 3、更新了"第四节 基金托管人"中的相关内容;

4、更新了"第五节 相关服务机构"中销售机构的相关信息及审计基金财产的会计师事务所经 5、更新了"第十节 基金的投资"中基金投资组合报告,更新至2014年3月31日;

6、更新了"第十一节 基金的业绩",更新至 2013 年 12 月 31 日; 7、更新了"第二十三节 对基金份额持有人的服务"的相关内容;

8、更新了"第二十四节 其他应披露的事项",披露了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的 上述内容仅为本更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为 准。欲查询本更新招募说明书正文,可登录国泰基金管理有限公司网站 www.gtfu

国泰基金管理有限公司