



信息披露

2014年1月22日 星期三
zqsb@stcn.com (0755)83501570

B106

深证基本面200交易型开放式指数证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

基金管理人:博时基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月22日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金注册登记机构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。
基金管理人交通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。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| 基金名称 | 博时上证基本面200ETF |
|------------|--|
| 场内简称 | 深证200 |
| 基金代码 | 159008 |
| 交易所代码 | 159008 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式指数基金 |
| 基金合同生效日 | 2011年6月10日 |
| 报告期末基金资产总额 | 182,729,389.07 |
| 投资组合 | 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,跟踪标的指数的成份股及其权重,并根据基金资产规模进行仓位调整,并合理的使用股指期货及其他金融衍生品进行辅助调整。 |
| 风险控制措施 | 本基金通过分散化投资,分散非系统性风险,同时通过分散化投资,分散非系统性风险,同时通过分散化投资,分散非系统性风险。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金,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。 |
| 跟踪误差控制 | 本基金力争跟踪误差控制在年化跟踪误差小于2%以内,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.22%,力争年化跟踪误差小于2%。 |
| 基金管理人 | 博时基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |

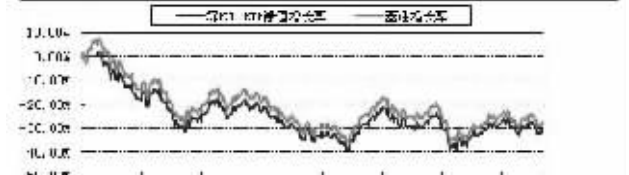
§3 主要财务指标和基金净值表现

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------------------|---------|--------------|
| 1 | 本期基金份额净值增长率 | 1.0000 | 1.0000 |
| 2 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 3 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 4 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 5 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 6 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 7 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 8 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 9 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 10 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |

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。
上述基金净值增长率指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资者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① | 净值增长率与基准差② | 净值增长率与基准差③ | ①-③ | ②-③ |
|-------|--------|------------|------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -2.67% | 1.27% | -2.40% | 1.27% | -0.01% |

3.2.2自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



注:本基金的基金合同于2011年6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“三、(二)投资组合”、“(八)投资禁止行为及限制”的有关规定。本基金建仓期时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理时间 | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|-------------|--------|----|
| 方维坤 | 基金经理 | 2012-1-13 | - | 3 |

4.2报告期内本基金运作合规情况说明
在本报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、《证券投资基金运作管理办法》及其他法律法规,基金管理人严格遵守了《证券投资基金运作管理办法》及其他法律法规,基金管理人严格遵守了《证券投资基金运作管理办法》及其他法律法规。

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。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1报告期内基金投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.2报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.3报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.5报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.6报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.7报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.8报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.9报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.10报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.11报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.12报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.13报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.14报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.15报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.16报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.17报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.18报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.19报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.20报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.21报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.22报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.23报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.24报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.25报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.26报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.27报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.28报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.29报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.30报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.31报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.32报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.33报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.34报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.35报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.36报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.37报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.38报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.39报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.40报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.41报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

| 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 | 399,822.32 | 0.32 |
| B | 矿业 | 4,751,456.57 | 3.75 |
| C | 制造业 | 79,219,966.62 | 62.52 |
| D | 电力、热力、燃气及生产供应业 | 3,155,117.90 | 2.49 |
| E | 建筑业 | 7,531,748.48 | 6.08 |
| F | 交通运输、仓储和邮政业 | 10,262,416.67 | 8.11 |
| G | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,496,451.37 | 1.18 |
| H | 金融业 | 772,902.10 | 0.61 |
| I | 房地产业 | 10,921,765.63 | 8.62 |
| J | 批发和零售业 | 12,695,724.36 | 9.52 |
| K | 住宿和餐饮业 | 185,586.18 | 0.15 |
| L | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| M | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,300,080.80 | 1.03 |
| N | 教育 | - | - |
| O | 卫生和社会工作 | - | - |
| P | 文化、体育和娱乐业 | 284,208.88 | 0.22 |
| Q | 综合 | 338,489.55 | 0.27 |
| 合计 | | 125,903,413.35 | 99.36 |

§3 报告期内基金资产净值、基金份额净值、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------------------|---------|--------------|
| 1 | 本期基金份额净值增长率 | 1.0000 | 1.0000 |
| 2 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 3 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 4 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 5 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 6 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 7 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 8 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 9 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 10 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |

4.4.10报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.11报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.12报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.13报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.14报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.15报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.16报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.17报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.18报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.19报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.20报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.21报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.22报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.23报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.24报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.25报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.26报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.27报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.28报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.29报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.30报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.31报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.32报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.33报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.34报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.35报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.36报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.37报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.38报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.39报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.40报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.41报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.42报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.43报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.44报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.45报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.46报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.47报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.48报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.49报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.50报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.51报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.52报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.53报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.54报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.55报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.56报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.57报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.58报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.4.59报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本基金为完全被动式指数基金,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年12月31日

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

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金注册登记机构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。
基金的过往业绩并不预示其未来表现,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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| 基金名称 | 博时上证自然资源ETF |
|------------|--|
| 场内简称 | 资源ETF |
| 基金代码 | 510400 |
| 交易所代码 | 510400 |
| 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11日 |
| 报告期末基金资产总额 | 59,228,807.01 |
| 投资组合 | 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,跟踪标的指数的成份股及其权重,并根据基金资产规模进行仓位调整,并合理的使用股指期货及其他金融衍生品进行辅助调整。 |
| 风险控制措施 | 本基金通过分散化投资,分散非系统性风险,同时通过分散化投资,分散非系统性风险,同时通过分散化投资,分散非系统性风险。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金,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。 |
| 跟踪误差控制 | 本基金力争跟踪误差控制在年化跟踪误差小于2%以内,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.22%,力争年化跟踪误差小于2%。 |
| 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 |

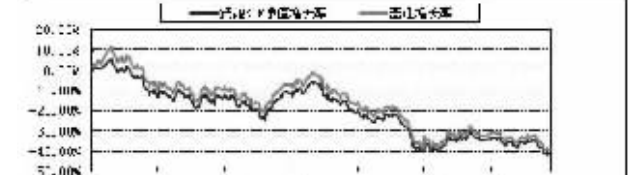
§3 主要财务指标和基金净值表现

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------------------------|---------|--------------|
| 1 | 本期基金份额净值增长率 | 1.0000 | 1.0000 |
| 2 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 3 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 4 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 5 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 6 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 7 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 8 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 9 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |
| 10 | 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额 | -0.0000 | -0.0000 |

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。
上述基金净值增长率指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资者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① | 净值增长率与基准差② | 净值增长率与基准差③ | ①-③ | ②-③ |
|-------|---------|------------|------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -10.65% | 1.14% | -10.29% | 1.14% | -0.06% |

3.2.2自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



注:本基金的基金合同于2012年4月11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“三、(二)投资组合”、“(八)投资限制”的有关规定。本基金建仓期时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告