

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
2024 年中期报告
2024 年 6 月 30 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：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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代表其未来表现。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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末投资目标基金明细.....	35
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	38
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	39
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	39
7.11 本基金投资股指期货的投资政策.....	39

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.13 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	40
§9 开放式基金份额变动	40
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息	44
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	博时上证自然资源 ETF 联接	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	256,646,930.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时上证自然资源 ETF 联接 A	博时上证自然资源 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	050024	019910
报告期末下属分级基金的份额总额	239,227,877.62 份	17,419,053.12 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	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
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 11 日
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

2.2 基金产品说明

投资目标	通过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，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	<p>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，方便特定的客户群通过本基金投资上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金。</p> <p>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。投资策略包括资产配置策略、目标 ETF 投资策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货及其他金融衍生品的投资策略。</p> <p>为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金。在正常市场情况下，本基金力争净</p>

	值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	上证自然资源指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
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基金联接基金，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。

2.2.1 目标基金产品说明

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指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。
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。该指数属于价格指数。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		博时基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙麒清	王小飞
	联系电话	0755-83169999	021-60637103
	电子邮箱	service@bosera.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95105568	021-60637228
传真		0755-83195140	021-60635778
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518040	100033
法定代表人		江向阳	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com

基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处
------------	--------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街8号中粮广场C座3层301

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024年1月1日至2024年6月30日）	
	博时上证自然资源ETF 联接A	博时上证自然资源ETF 联接C
本期已实现收益	1,325,957.65	-22,789.42
本期利润	27,309,380.94	-952,461.45
加权平均基金份额本期利润	0.1242	-0.1496
本期加权平均净值利润率	10.55%	-12.15%
本期基金份额净值增长率	13.67%	13.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	博时上证自然资源ETF 联接A	博时上证自然资源ETF 联接C
期末可供分配利润	-60,698,992.49	-4,454,002.19
期末可供分配基金份额利润	-0.2537	-0.2557
期末基金资产净值	288,513,797.17	20,974,000.34
期末基金份额净值	1.2060	1.2041
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	博时上证自然资源ETF 联接A	博时上证自然资源ETF 联接C
基金份额累计净值增长率	20.60%	15.08%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

博时上证自然资源 ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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—④
过去一个月	-3.38%	1.10%	-4.59%	1.12%	1.21%	-0.02%
过去三个月	-0.12%	1.24%	-1.83%	1.28%	1.71%	-0.04%
过去六个月	13.67%	1.28%	12.06%	1.32%	1.61%	-0.04%
过去一年	13.89%	1.07%	10.34%	1.09%	3.55%	-0.02%
过去三年	39.16%	1.41%	26.07%	1.44%	13.09%	-0.03%
自基金合同生效起至今	20.60%	1.58%	6.40%	1.61%	14.20%	-0.03%

博时上证自然资源 ETF 联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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—④
过去一个月	-3.40%	1.10%	-4.59%	1.12%	1.19%	-0.02%
过去三个月	-0.19%	1.24%	-1.83%	1.28%	1.64%	-0.04%
过去六个月	13.50%	1.28%	12.06%	1.32%	1.44%	-0.04%
自基金合同生效起至今	15.08%	1.17%	13.70%	1.19%	1.38%	-0.02%

注：自 2023 年 11 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 11 月 8 日，相关数据按实际存续期计算。

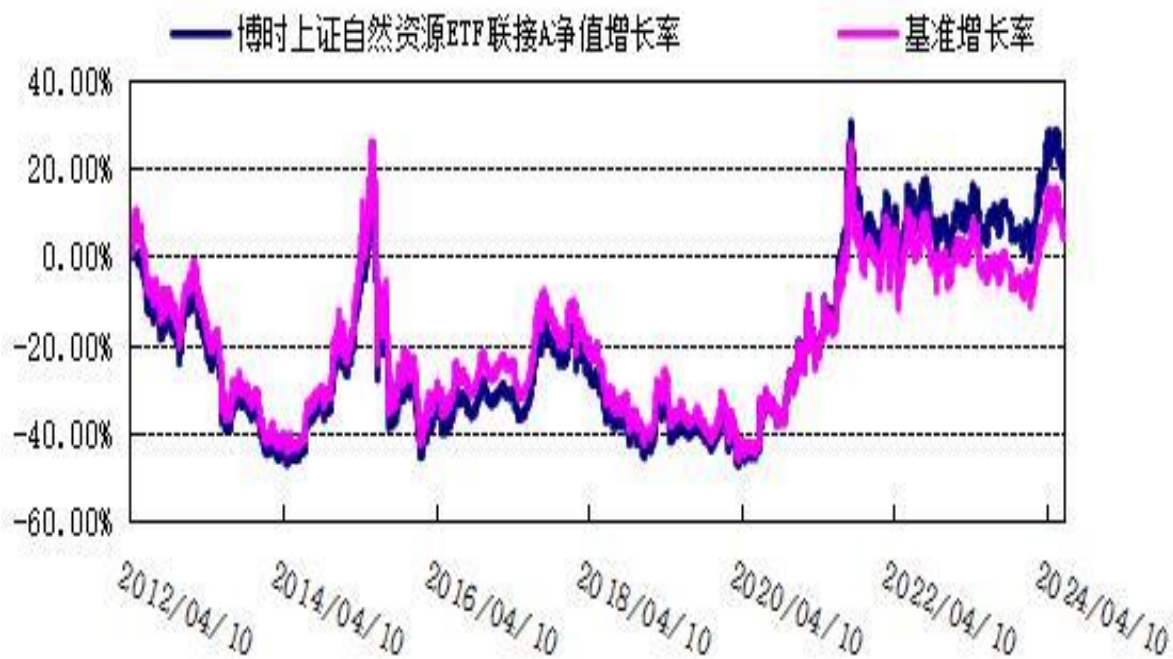
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 4 月 10 日至 2024 年 6 月 30 日)

博时上证自然资源 ETF 联接 A



博时上证自然资源 ETF 联接 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 385 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16037 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5965 亿元人民币，累计分红逾 2009 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王祥	基金经理	2016-11-02	-	11.9	王祥先生，硕士。2006 年起先后在中粮期货、工商银行总行工作。2015 年加入博时基金管理有限公司。曾任基金经理助理。现任博时黄金交易型开放式证券投资基金联接基金(2016 年 11 月 2 日—至今)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2016 年 11 月 2 日—至今)、博时黄金交易型开放式证券投资基金(2016 年 11 月 2 日—至今)、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(2016 年 11 月 2 日—至今)、博时中证光伏产业指数证券投资基金(2022 年 8 月 16 日—至今)、博时中证疫苗与生物技术交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 11 月 8 日—至今)、博时中证农业主题指数型发起式证券投资基金(2022 年 12 月 13 日—至今)、博时中证有色金属矿业主题指数证券投资基金(2023 年 5 月 16 日—至今)、博时标普石油天然气勘探及

					生产精选行业指数型发起式证券投资基金（QDII）（2023 年 9 月 5 日一至今）、博时中证建设工程指数型发起式证券投资基金（2024 年 3 月 19 日一至今）、博时国证粮食产业指数型发起式证券投资基金（2024 年 4 月 9 日一至今）、博时中证油气资源交易型开放式指数证券投资基金（2024 年 4 月 19 日一至今）的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-03-06	-	7.9	王萌先生，博士。2016 年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 81 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年第 2 季度 A 股市场波动继续维持在较高水平，自 2 月以来，得益于监管层对于股市的政策呵护与漏洞封堵提振了市场情绪，市场修复一度持续至 4 月中旬。但之后伴随着 CPI、社融等经济指标的显著弱化，市场对于经济通缩预期加剧，影响了企业端的业绩前景。叠加监管机构对于上市公司的财务监察工作的趋严，部分中小市值公司的财务质量、公司治理等环节暴露出较大风险，继续压承市场风险偏好。万得全 A 指数上半年走低 8.01%，整体表现较为孱弱。

上证资源指数所代表的上游强周期行业除了一度受益于季度之初大宗商品端的再通胀交易外，其自身的高股息特征也成为弱势市场中资金的避风港。上证资源指数上半年收涨 12.66%，显著跑赢主流宽基指数。

从细分行业来看，上证资源中的煤炭板块以其全 A 领先的股息率回报成为调整市场中资金抵御风险的主要方向，中信煤炭一级行业指数上半年收涨 12.79%，在整体资源品中持续贡献稳定的支持力量。在煤价本身的价格波动层面，随着需求的不断低于预期，终端累库进一步加剧。坑口与港口煤价在季初的反弹后再次进入弱势盘整的态势，部分地区竞价出现流标。不过长协的发运整体维持稳定，6 月北方港电煤 Q5500 年度长协价为 700 元/吨，较上月还略有上调。煤炭板块估值的重塑正在途中，背后反应的不仅是煤炭行业深刻供需结构变化，逐步“公用事业化”，而且也反映了在资产荒背景下，无风险收益率下行趋势下的高股息资产更加受到市场青睐的投资策略问题。

石油石化板块上半年表现也相对稳定，受中东地缘局势与欧美宽松预期影响，国际油价上半年表现逞强，也为权益市场表现提供了契机。行业板块半年度收涨 11.36%，在全部一级行业中表现相对居前。当前全球炼能低速增长，短期供需错配持续，成品油需求强劲，化工品呈现复苏状态。随着出行需求的稳步提升，汽油消费同比改善；同时，海外成品油旺季需求较好，推动国内汽油、柴油出口有所提升；虽然原油等原料成本处于中高位，不过终端需求有所改善，部分化工品盈利改善。展望未来，随着经济持续改善、出口保持高景气度、消费需求持续复苏，行业整体盈利能力有望改善。

资源品中的金属方向上半年表现分化，工业金属、贵金属领域其底层资产自去年末开始即表现顽强，引领资源指数中的贵金属与工业金属分项迭创新高点。而小金属与能源金属板块，则受到新能源终端关税扰动和下游需求持续低迷的影响，表现相对萎靡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2060 元，份额累计净值为 1.2060 元，

本基金 C 类基金份额净值为 1.2041 元，份额累计净值为 1.2041 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 13.67%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 13.50%，同期业绩基准增长率为 12.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 下半年，资源品行业整体依然有望维持相对优势。高股息与周期复苏的双逻辑支持是当前不确定较高市场下的较优配置策略。同时随着地缘博弈烈度的加强与宽松节点的临近，三季度的大宗商品领域或仍可值得期待。整体而言，实物资产的价值重估仍是当前宏观背景下的主要逻辑，这一逻辑的持续力或显著超出市场的预期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.3.1	15,459,278.43	11,005,309.92
结算备付金		134,737.02	-
存出保证金		14,731.75	3,007.28
交易性金融资产	6.4.3.2	293,947,271.79	209,882,696.16
其中：股票投资		6,062.00	763,161.75
基金投资		293,635,752.67	208,711,762.79

债券投资		305,457.12	407,771.62
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		2,456,536.45	425,631.85
应收股利		-	-
应收申购款		898,716.39	344,429.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		312,911,271.83	221,661,075.00
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,178.88	-
应付赎回款		3,266,904.79	719,334.28
应付管理人报酬		8,936.73	4,988.58
应付托管费		1,787.34	997.72
应付销售服务费		5,542.53	27.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	139,124.05	173,176.11
负债合计		3,423,474.32	898,524.14
净资产：			
实收基金	6.4.3.8	256,646,930.74	208,061,905.87
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	52,840,866.77	12,700,644.99
净资产合计		309,487,797.51	220,762,550.86
负债和净资产总计		312,911,271.83	221,661,075.00

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 256,646,930.74 份。其中 A 类基金份额净值 1.2060 元，基金份额总额 239,227,877.62 份；C 类基金份额净值 1.2041 元，基金份额总额 17,419,053.12 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		26,507,006.15	13,522,690.21
1. 利息收入		27,500.21	19,592.64
其中：存款利息收入	6.4.3.10	27,500.21	19,592.64
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,202,894.65	5,567,360.36
其中：股票投资收益	6.4.3.11	-450,144.75	-71,106.30
基金投资收益	6.4.3.12	1,601,495.12	5,604,549.54
债券投资收益	6.4.3.13	5,061.56	33,759.62
资产支持证券投资收益	6.4.3.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.15	-	-
股利收益	6.4.3.16	46,482.72	157.50
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	25,053,751.26	7,818,273.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.18	222,860.03	117,463.53
减：二、营业总支出		150,086.66	129,984.90
1. 管理人报酬		44,321.48	34,450.25
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		8,864.30	6,889.99
3. 销售服务费		11,388.40	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.19	-	-
7. 税金及附加		488.04	2,758.62
8. 其他费用	6.4.3.20	85,024.44	85,886.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号		26,356,919.49	13,392,705.31

填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,356,919.49	13,392,705.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		26,356,919.49	13,392,705.31

6.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	208,061,905.87	-	12,700,644.99	220,762,550.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	208,061,905.87	-	12,700,644.99	220,762,550.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	48,585,024.87	-	40,140,221.78	88,725,246.65
（一）、综合收益总额	-	-	26,356,919.49	26,356,919.49
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	48,585,024.87	-	13,783,302.29	62,368,327.16
其中：1. 基金申购款	179,813,574.31	-	40,335,666.08	220,149,240.39
2. 基金赎回款	-131,228,549.44	-	-26,552,363.79	-157,780,913.23
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收	-	-	-	-

益结转留存收益				
四、本期期末净资产	256,646,930.74	-	52,840,866.77	309,487,797.51
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	263,222,171.30	-	3,782,451.27	267,004,622.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	263,222,171.30	-	3,782,451.27	267,004,622.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-39,388,556.57	-	9,393,684.21	-29,994,872.36
（一）、综合收益总额	-	-	13,392,705.31	13,392,705.31
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-39,388,556.57	-	-3,999,021.10	-43,387,577.67
其中：1. 基金申购款	39,804,790.95	-	3,795,806.47	43,600,597.42
2. 基金赎回款	-79,193,347.52	-	-7,794,827.57	-86,988,175.09
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	223,833,614.73	-	13,176,135.48	237,009,750.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：陈子成

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。(4) 基

金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。(5) 本基金的城
市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	15,459,278.43
等于：本金	15,457,713.05
加：应计利息	1,565.38
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	15,459,278.43

6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	6,243.51	-	6,062.00	-181.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	4,707.12	305,457.12	-477.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,707.12	305,457.12	-477.00
资产支持证券	-	-	-	-

基金	248,500,560.14	-	293,635,752.67	45,135,192.53
其他	-	-	-	-
合计	248,808,030.65	4,707.12	293,947,271.79	45,134,534.02

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.3.5 其他权益工具投资

6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.3.6 其他资产

无余额。

6.4.3.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,167.78
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	45,917.77
其中：交易所市场	45,917.77
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,038.50
合计	139,124.05

6.4.3.8 实收基金

博时上证自然资源 ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	207,937,892.87	207,937,892.87
本期申购	149,601,665.11	149,601,665.11
本期赎回（以“-”号填列）	-118,311,680.36	-118,311,680.36
本期末	239,227,877.62	239,227,877.62

博时上证自然资源 ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	124,013.00	124,013.00
本期申购	30,211,909.20	30,211,909.20
本期赎回（以“-”号填列）	-12,916,869.08	-12,916,869.08
本期末	17,419,053.12	17,419,053.12

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。

6.4.3.9 未分配利润
博时上证自然资源 ETF 联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-54,161,181.57	66,854,277.16	12,693,095.59
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-54,161,181.57	66,854,277.16	12,693,095.59
本期利润	1,325,957.65	25,983,423.29	27,309,380.94
本期基金份额交易产生的变动数	-7,863,768.57	17,147,211.59	9,283,443.02
其中：基金申购款	-38,031,565.01	70,860,546.60	32,828,981.59
基金赎回款	30,167,796.44	-53,713,335.01	-23,545,538.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,698,992.49	109,984,912.04	49,285,919.55

博时上证自然资源 ETF 联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-32,335.50	39,884.90	7,549.40
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-

本期期初	-32,335.50	39,884.90	7,549.40
本期利润	-22,789.42	-929,672.03	-952,461.45
本期基金份额交易产生的变动数	-4,398,877.27	8,898,736.54	4,499,859.27
其中：基金申购款	-7,706,801.13	15,213,485.62	7,506,684.49
基金赎回款	3,307,923.86	-6,314,749.08	-3,006,825.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,454,002.19	8,008,949.41	3,554,947.22

6.4.3.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	26,724.98	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	690.23	
其他	85.00	
合计	27,500.21	

6.4.3.11 股票投资收益

6.4.3.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-42,719.52	
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-407,425.23	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	-450,144.75	

6.4.3.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	17,567,712.47	
减：卖出股票成本总额	17,540,606.41	
减：交易费用	69,825.58	
买卖股票差价收入	-42,719.52	

6.4.3.11.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
申购基金份额总额	50,667,100.00
减：现金支付申购款总额	313,446.62
减：申购股票成本总额	50,761,078.61
减：交易费用	-
申购差价收入	-407,425.23

6.4.3.12 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	11,103,559.69
减：卖出/赎回基金成本总额	9,495,780.07
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	4,066.98
减：交易费用	2,217.52
基金投资收益	1,601,495.12

6.4.3.13 债券投资收益

6.4.3.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,166.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-105.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,061.56

6.4.3.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,476,440.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,400,105.00
减：应计利息总额	76,440.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-105.00

6.4.3.14 资产支持证券投资收益

6.4.3.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

6.4.3.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

6.4.3.15 衍生工具收益

6.4.3.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

6.4.3.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

6.4.3.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	46,482.72
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	46,482.72

6.4.3.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	25,053,751.26
——股票投资	-20,805.51
——债券投资	-717.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	25,075,273.77
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	25,053,751.26

6.4.3.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	213,495.53
基金转换费收入	9,364.50
合计	222,860.03

6.4.3.19 信用减值损失

无发生额。

6.4.3.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,366.16
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	985.94
合计	85,024.44

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金（“目标ETF”）	基金管理人管理的其他基金
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	44,321.48	34,450.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	259,198.31	237,201.57
应支付基金管理人的净管理费	-214,876.83	-202,751.32

注：本基金投资于目标 ETF 部分不收取管理费。支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的目标 ETF 部分后的余额(若为负数，则取零)0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值扣除本基金持有的目标 ETF 部分后的余额(若为负数，则取零)×0.50%/当年天数。

由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,864.30	6,889.99

注：本基金投资于目标 ETF 部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的目标 ETF 部分后的余额(若为负数，则取零)0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的目标 ETF 部分后的余额(若为负数，则取零)×0.10%/当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时上证自然资源 ETF 联接 A	博时上证自然资源 ETF 联接 C	合计
博时基金	-	2,461.71	2,461.71
博时财富	-	410.87	410.87
合计	-	2,872.58	2,872.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时上证自然资源 ETF 联接 A	博时上证自然资源 ETF 联接 C	合计
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	15,459,278.43	26,724.98	8,586,402.07	19,412.60

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

于本期末，本基金持有 238,670,042.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 52.54%（上

年度末：本基金持有 193,341,142.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 59.63%。

6.4.7 利润分配情况

无。

6.4.8 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所表征的市场组合相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监

察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	305,457.12	407,771.62
合计	305,457.12	407,771.62

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	15,459,278.43	-	-	-	15,459,278.43
结算备付金	134,737.02	-	-	-	134,737.02
存出保证金	14,731.75	-	-	-	14,731.75

交易性金融资产	305,457.12	-	-	-293,641,814.67	293,947,271.79
应收清算款	-	-	-	2,456,536.45	2,456,536.45
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	898,716.39	898,716.39
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	15,914,204.32	-	-	-296,997,067.51	312,911,271.83
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,266,904.79	3,266,904.79
应付清算款	-	-	-	1,178.88	1,178.88
应付管理人报酬	-	-	-	8,936.73	8,936.73
应付托管费	-	-	-	1,787.34	1,787.34
应付销售服务费	-	-	-	5,542.53	5,542.53
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	139,124.05	139,124.05
负债总计	-	-	-	3,423,474.32	3,423,474.32
利率敏感度缺口	15,914,204.32	-	-	-293,573,593.19	309,487,797.51
上年度末					
2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,005,309.92	-	-	-	11,005,309.92
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	3,007.28	-	-	-	3,007.28
交易性金融资产	407,771.62	-	-	-209,474,924.54	209,882,696.16
应收清算款	-	-	-	425,631.85	425,631.85
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	344,429.79	344,429.79
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,416,088.82	-	-	-210,244,986.18	221,661,075.00
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	719,334.28	719,334.28
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,988.58	4,988.58
应付托管费	-	-	-	997.72	997.72

应付销售服务费	-	-	27.45	27.45
应交税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	173,176.11	173,176.11
负债总计	-	-	898,524.14	898,524.14
利率敏感度缺口	11,416,088.82	-	-209,346,462.04	220,762,550.86

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 0	减少约 0
市场利率下降 25 个基点	增加约 0	增加约 0	

注：以上金额为四舍五入的结果。

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	6,062.00	0.00	763,161.75	0.35
交易性金融资产—基金投资	293,635,752.67	94.88	208,711,762.79	94.54
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	293,641,814.67	94.88	209,474,924.54	94.89

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为0。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约1,437	增加约1,026
	业绩比较基准下降5%	减少约1,437	减少约1,026

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日
第一层次	293,641,814.67
第二层次	305,457.12
第三层次	-
合计	293,947,271.79

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,062.00	0.00
	其中：股票	6,062.00	0.00
2	基金投资	293,635,752.67	93.84
3	固定收益投资	305,457.12	0.10
	其中：债券	305,457.12	0.10
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,594,015.45	4.98
8	其他各项资产	3,369,984.59	1.08
9	合计	312,911,271.83	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	博时上证自然资源ETF	指数型基金	交易型开放式指数基金	博时基金管理有限公司	293,635,752.67	94.88

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	5,160.00	0.00
C	制造业	902.00	0.00
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,062.00	0.00

7.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601808	中海油服	300	5,160.00	0.00
2	601952	苏垦农发	100	902.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	601857	中国石油	3,432,873.00	1.56
2	601899	紫金矿业	3,415,246.00	1.55
3	601225	陕西煤业	3,180,145.00	1.44
4	601088	中国神华	3,088,175.00	1.40
5	600028	中国石化	2,856,365.00	1.29
6	603993	洛阳钼业	2,532,784.00	1.15
7	600938	中国海油	2,507,849.00	1.14
8	601600	中国铝业	2,412,182.00	1.09
9	600547	山东黄金	2,211,878.08	1.00
10	600111	北方稀土	2,060,675.00	0.93
11	603799	华友钴业	1,620,103.00	0.73
12	600489	中金黄金	1,595,312.00	0.72
13	601168	西部矿业	1,537,825.00	0.70
14	600256	广汇能源	1,461,584.00	0.66
15	600188	兖矿能源	1,388,109.00	0.63
16	600988	赤峰黄金	1,236,755.00	0.56
17	600157	永泰能源	1,220,874.00	0.55
18	600176	中国巨石	1,154,179.00	0.52
19	601699	潞安环能	1,089,978.00	0.49
20	600362	江西铜业	1,080,710.00	0.49

注：本项“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601225	陕西煤业	971,802.00	0.44
2	601857	中国石油	956,423.00	0.43
3	601088	中国神华	949,787.00	0.43
4	601899	紫金矿业	918,169.00	0.42
5	600028	中国石化	909,090.80	0.41
6	600938	中国海油	818,636.00	0.37
7	601600	中国铝业	737,792.00	0.33
8	603993	洛阳钼业	709,694.00	0.32
9	600111	北方稀土	639,603.00	0.29
10	600547	山东黄金	636,368.00	0.29
11	600489	中金黄金	507,278.00	0.23
12	603799	华友钴业	493,873.00	0.22
13	600256	广汇能源	465,351.00	0.21
14	600188	兖矿能源	452,677.00	0.21
15	601168	西部矿业	436,083.00	0.20

16	600157	永泰能源	394,189.00	0.18
17	601699	潞安环能	359,803.00	0.16
18	600988	赤峰黄金	354,500.00	0.16
19	600176	中国巨石	342,321.00	0.16
20	600219	南山铝业	329,148.00	0.15

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	57,184,092.78
卖出股票的收入（成交）总额	17,567,712.47

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	305,457.12	0.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	305,457.12	0.10

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019727	23 国债 24	3,000	305,457.12	0.10

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,731.75
2	应收清算款	2,456,536.45
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	898,716.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,369,984.59

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
博时上证自然资源 ETF 联接 A	159,573	1,499.18	95,323.71	0.04%	239,132,553.91	99.96%
博时上证自然资源 ETF 联接 C	3,633	4,794.67	7,353,832.44	42.22%	10,065,220.68	57.78%
合计	162,910	1,575.39	7,449,156.15	2.90%	249,197,774.59	97.10%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时上证自然资源 ETF 联接 A	117,848.50	0.05%
	博时上证自然资源 ETF 联接 C	48,423.96	0.28%
	合计	166,272.46	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时上证自然资源 ETF 联接 A	博时上证自然资源 ETF 联接 C
基金合同生效日(2012年4月10日)基金份额总额	309,533,849.25	-

本报告期期初基金份额总额	207,937,892.87	124,013.00
本报告期基金总申购份额	149,601,665.11	30,211,909.20
减：本报告期基金总赎回份额	118,311,680.36	12,916,869.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	239,227,877.62	17,419,053.12

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2024 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生任公司总经理。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起，聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	2,457,982.94	3.29%	2,324.81	4.13%	增加 1 个
东兴证券	1	72,293,822.31	96.71%	53,923.61	95.87%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中	-	-	-	-	-	-	-	-

信建投									
东兴证券	3,301,532.00	100.00%	-	-	-	-	19,403,475.20	100.00%	
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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（博时上证自然资源 ETF 联接 A）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-26
2	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（博时上证自然资源 ETF 联接 C）基金产品资料概要更新	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-26
3	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-25
4	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
5	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
6	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通上海银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
7	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 2024 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-22
8	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-13
9	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 2023 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披	2024-03-29

		露网站	
10	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 2023 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准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设立的文件
- 2、《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基金合同》
- 3、《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托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、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各年度审计报告正本
- 6、报告期内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在指定报刊上各项公告的原稿

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日