

# 南方中证申万有色金属交易型开放式 指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 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.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
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.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	75
7.1 期末基金资产组合情况.....	76
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	76
7.3 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.....	77
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	80
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	82
7.6 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.....	82
7.7 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.....	82
7.8 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.....	82
7.9 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.....	82
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	83

7.12 投资组合报告附注.....	83
§8 基金份额持有人信息.....	84
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	84
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	85
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	85
8.4 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情况.....	85
§9 开放式基金份额变动.....	85
§10 重大事件揭示.....	86
10.1 基金份额持有人大会决议.....	86
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.....	86
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	86
10.4 基金投资策略的改变.....	86
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	86
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.....	86
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	86
10.8 其他重大事件.....	88
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
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.....	89
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§12 备查文件目录.....	90
12.1 备查文件目录.....	90
12.2 存放地点.....	90
12.3 查阅方式.....	90

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证申万有色金属 ETF
场内简称	有色 ETF（有色金属 ETF）
基金主代码	512400
交易代码	512400
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2017 年 8 月 3 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,859,039,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017 年 9 月 1 日

### 2.2 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最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重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。
业绩比较基准	中证申万有色金属指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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	南方基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95588
传真	0755-82763889	010-66105798
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	厦 32-42 楼	
办公地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518017	100140
法定代表人	周易	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、 基金上市交易的证券交易所（如有）

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-92,062,145.26
本期利润	-227,564,280.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0671
本期加权平均净值利润率	-6.00%
本期基金份额净值增长率	-2.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	127,533,066.11
期末可供分配基金份额利润	0.0330
期末基金资产净值	3,986,572,066.11
期末基金份额净值	1.0330
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.30%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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；

2、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；

3、对期末可供分配利润，采用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。

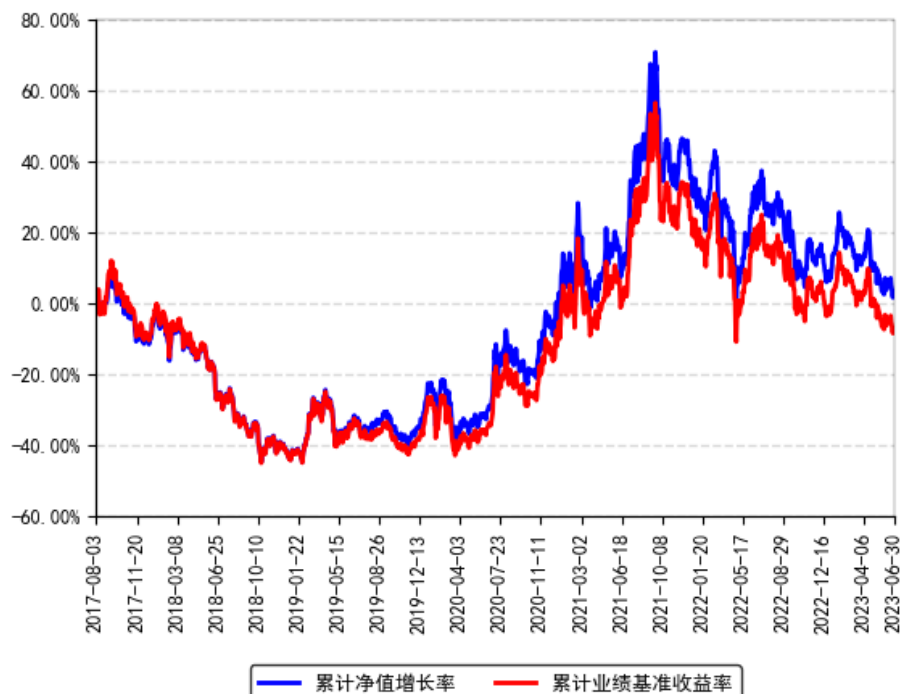
### 3.2 基金净值表现

#### 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

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	0.84%	1.32%	0.08%	1.30%	0.76%	0.02%
过去三个月	-8.04%	1.42%	-9.34%	1.42%	1.30%	0.00%
过去六个月	-2.88%	1.37%	-4.22%	1.37%	1.34%	0.00%
过去一年	-21.44%	1.54%	-22.54%	1.54%	1.10%	0.00%
过去三年	45.92%	2.12%	40.76%	2.13%	5.16%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.30%	1.90%	-7.37%	1.93%	10.67%	-0.03%

#### 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

南方中证申万有色金属ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

### 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		
崔蕾	本基金基金经理	2019 年 7 月 12 日	-	8 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险经理师（FRM），特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2020 年 3 月 26 日至 2023 年 3 月 27 日，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2018 年 11 月 8 日至今，任南方中证 500 增强基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理；2019 年 11 月 29 日至今，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理；2021 年 8 月 19

					日至今，任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理；2021 年 9 月 27 日至今，任南方中证 1000 联接基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，任南方国证在线消费 ETF 基金经理；2022 年 1 月 26 日至今，任南方中证 500 增强策略 ETF 基金经理；2022 年 11 月 23 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理；2022 年 12 月 1 日至今，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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% 的交易次数为 13 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

## 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

有色金属指数报告期内下跌 4.22%。

建仓完成后，我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本 ETF 基金的安全运作。

我们对本基金跟踪误差归因分析如下：

- (1) 新股上市初期涨幅较大的影响；
- (2) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (3) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；
- (4) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内；
- (5) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0330 元，报告期内，份额净值增长率为-2.88%，同期业绩基准增长率为-4.22%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

有色金属作为顺周期行业，与海内外经济数据均有紧密联系。站在当前时点看，中美去库存接近尾声，且下半年下游需求有望逐步走强。国内有色的价格上半年主要依靠金融属性的支撑，但只有刺激政策与有效的消费需求才能真正地推动基本金属的拐点。近期的顶层会议带来了市场信心，虽然短期内预计不会出台大规模刺激措施，但对地产的态度转变、以及能源转型带来的行业增长，将持续推动国内金属需求下半年不断复苏。风险点在于锂等新能源金属，从碳酸锂期货上市后的贴水就能看出市场对于未来锂价的预判。而美国 7 月 Markit 制造业 PMI 初值 49.0，优于预期值 46.4，前值为 46.3。该数据与服务业数据相反，一方面证实美国制造业回流正在进行时，对全球工业金属都有提振作用；且工业去库存已经完成，工业金属价格有机会提前反应。另一方面，最近零售数据显示超额储蓄预计到年底将会使用完毕，就业收入上涨趋势减缓，说明加息接近尾声，黄金价格还有更进一步的空间。综上，我们原来预判有色行业在下半年有可能迎来拐点投资机会，目前左侧布局时机已到。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人依法对南方基金管理股份有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	17,386,982.47	2,171,265.95
结算备付金		3,694,534.38	2,270,137.41
存出保证金		663,243.11	605,460.67
交易性金融资产	6.4.3.2	3,982,199,275.29	2,909,054,721.54
其中：股票投资		3,982,199,275.29	2,909,054,721.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		272,120.32	1,159,274.24
应收股利		256,811.99	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	94,394.59	88,052.98
资产总计		4,004,567,362.15	2,915,348,912.79
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月

		日	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		12,360,099.77	779,774.62
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,603,877.77	1,277,217.24
应付托管费		320,775.54	255,443.46
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,595.35	11,586.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	3,697,947.61	1,790,730.36
负债合计		17,995,296.04	4,114,752.54
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	3,859,039,000.00	2,737,039,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	127,533,066.11	174,195,160.25
净资产合计		3,986,572,066.11	2,911,234,160.25
负债和净资产总计		4,004,567,362.15	2,915,348,912.79

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0330 元，基金份额总额 3,859,039,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-215,651,499.78	-106,544,429.22
1.利息收入		3,520,520.80	100,917.14
其中：存款利息收入	6.4.3.9	54,064.80	100,917.14
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		-	-

证券出借利息收入		3,466,456.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-88,235,128.06	-428,736,990.01
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-146,620,711.99	-454,411,219.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	199.96	4,216,164.90
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.3.12	-	-
衍生工具收益	6.4.3.13	172,242.14	-3,716,422.68
股利收益	6.4.3.14	58,213,141.83	25,174,487.33
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.3.15	-135,502,135.00	320,140,874.82
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.3.16	4,565,242.48	1,950,768.83
减：二、营业总支出		11,912,780.48	11,645,828.25
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	9,359,969.39	9,147,945.40
2.托管费	6.4.6.2.2	1,871,993.84	1,829,589.17
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
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		-	-
7.税金及附加		14,659.37	7.57
8.其他费用	6.4.3.17	666,157.88	668,286.11
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-227,564,280.26	-118,190,257.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		-227,564,280.26	-118,190,257.47
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-227,564,280.26	-118,190,257.47

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,737,039,000.00	-	174,195,160.25	2,911,234,160.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,737,039,000.00	-	174,195,160.25	2,911,234,160.25
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,122,000,000.00	-	-46,662,094.14	1,075,337,905.86
(一)、综合收益总额	-	-	-227,564,280.26	-227,564,280.26
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,122,000,000.00	-	180,902,186.12	1,302,902,186.12
其中：1.基金申购款	2,903,500,000.00	-	413,702,967.27	3,317,202,967.27
2.基金赎回款	-1,781,500,000.00	-	-232,800,781.15	-2,014,300,781.15
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	3,859,039,000.00	-	127,533,066.11	3,986,572,066.11
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,775,539,000.00	-	972,488,453.76	3,748,027,453.76

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,775,539,000.00	-	972,488,453.76	3,748,027,453.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-52,000,000.00	-	-114,585,254.41	-166,585,254.41
(一)、综合收益总额	-	-	-118,190,257.47	-118,190,257.47
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-52,000,000.00	-	3,605,003.06	-48,394,996.94
其中：1.基金申购款	3,484,000,000.00	-	733,047,032.26	4,217,047,032.26
2.基金赎回款	-3,536,000,000.00	-	-729,442,029.20	-4,265,442,029.20
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,723,539,000.00	-	857,903,199.35	3,581,442,199.35

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：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
基金管理人负责人              主管会计工作负责人              会计机构负责人

## 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	17,386,982.47
等于：本金	17,386,597.13
加：应计利息	385.34
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	17,386,982.47

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,538,395,224.90	-	3,982,199,275.29	-556,195,949.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	4,538,395,224.90	-	3,982,199,275.29	-556,195,949.61	

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,429,020.00	-	-	-
一指期货	2,429,020.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,429,020.00	-	-	-

#### 6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2307	IC2307	2.00	2,396,320.00	-32,700.00
合计				-32,700.00
减：可抵销期货暂收款				-32,700.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

### 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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

#### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.3.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	94,394.59
待摊费用	-
可收退补款	-
应收退补款	-
合计	94,394.59

#### 6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	154,131.07
其中：交易所市场	154,131.07
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	3,144,224.64
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	293,460.46
可退替代款	1,993.09
其他	-
合计	3,697,947.61

注 1. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

2. 应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

#### 6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,737,039,000.00	2,737,039,000.00
本期申购	2,903,500,000.00	2,903,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,781,500,000.00	-1,781,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,859,039,000.00	3,859,039,000.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

#### 6.4.3.8 未分配利润

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	773,569,184.45	-599,374,024.20	174,195,160.25
本期利润	-92,062,145.26	-135,502,135.00	-227,564,280.26
本期基金份额交易产生的变动数	304,056,410.11	-123,154,223.99	180,902,186.12
其中：基金申购款	785,341,841.05	-371,638,873.78	413,702,967.27
基金赎回款	-481,285,430.94	248,484,649.79	-232,800,781.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	985,563,449.30	-858,030,383.19	127,533,066.11

#### 6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,043.17
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	40,368.72
其他	2,652.91
合计	54,064.80

#### 6.4.3.10 股票投资收益

##### 6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-122,668,061.27
股票投资收益——赎回差价收入	-23,952,650.72
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-146,620,711.99

##### 6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,198,395,014.93
减：卖出股票成本总额	1,319,319,840.05
减：交易费用	1,743,236.15
买卖股票差价收入	-122,668,061.27

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

**6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	2,014,300,781.15
减：现金支付赎回款总额	886,475,232.15
减：赎回股票成本总额	1,151,778,199.72
减：交易费用	-
赎回差价收入	-23,952,650.72

**6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

**6.4.3.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

**6.4.3.11 债券投资收益****6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.34
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	199.62
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	199.96

**6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,200.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00
减：应计利息总额	0.34
减：交易费用	0.05
买卖债券差价收入	199.62

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

**6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

**6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

### 6.4.3.12 贵金属投资收益

#### 6.4.3.12.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：上述交易费用（如有）包含贵金属买卖产生的交易费用。

### 6.4.3.13 衍生工具收益

#### 6.4.3.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

#### 6.4.3.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	172,242.14

### 6.4.3.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	58,213,141.83
其中：证券出借权益补偿收入	5,280,002.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	58,213,141.83

### 6.4.3.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-135,473,995.00
——股票投资	-135,473,995.00
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-28,140.00
——权证投资	-
——期货投资	-28,140.00
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	-135,502,135.00

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

### 6.4.3.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	4,565,242.48
合计	4,565,242.48

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

### 6.4.3.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	561,598.19
银行费用	421.34
合计	666,157.88

指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 10,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

## 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

无。

### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

## 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
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人

华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金("南方中证申万有色金属ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

###### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	18,789,829.32	0.62%	45,544,424.33	1.11%
兴业证券	2,418,869,095.54	79.79%	3,342,415,043.50	81.24%

###### 6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	-	-	21,850,117.30	99.99%
兴业证券	1,200.01	100.00%	1,132.10	0.01%

###### 6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	1,879.08	0.62%	1,224.79	0.79%
兴业证券	241,911.57	79.79%	106,803.17	69.29%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

华泰证券	4,554.44	1.11%	2,448.00	0.98%
兴业证券	334,267.53	81.24%	194,312.38	77.46%

注:1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,359,969.39	9,147,945.40
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的 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 × 0.50% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,871,993.84	1,829,589.17

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 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 × 0.10% / 当年天数。

##### 6.4.6.2.3 销售服务费

无。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	817,607,618.00	698,931.40	20,615,912.00	10,375.84

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	-	-	-	-

#### 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

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:)	出借期限 (单位:)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2023063000018900	江西铜业	2023年6月30日	134,758.00	7,100.00	14	1.50	-	134,758.00	-
华泰证券	2023063000018927	融捷股份	2023年6月30日	93,562.00	1,400.00	14	1.50	-	93,562.00	-
华泰证券	2023063000019001	腾远钴业	2023年6月30日	37,360.00	1,000.00	14	1.50	-	37,360.00	-
华泰证券	2023063000019045	锡业股份	2023年6月30日	104,185.00	6,700.00	14	1.50	-	104,185.00	-
华泰证券	2023063000019075	中金岭南	2023年6月30日	85,025.00	17,900.00	14	1.50	-	85,025.00	-
华泰证券	2023063000019076	铜陵有色	2023年6月30日	145,656.00	50,400.00	14	1.50	-	145,656.00	-
华泰证券	20230630000	石英股份	2023年6月30日	136,608.00	1,200.00	14	1.50	-	136,608.00	-

	019130		月30日							
华泰证券	2023063000019305	神火股份	2023年6月30日	143,000.00	11,000.00	14	1.50	-	143,000.00	-
华泰证券	2023063000019381	天华新能	2023年6月30日	146,780.00	4,100.00	14	1.50	-	146,780.00	-
华泰证券	2023063000019475	永兴材料	2023年6月30日	137,742.00	2,200.00	14	1.50	-	137,742.00	-
华泰证券	2023063000019511	北方稀土	2023年6月30日	412,456.00	17,200.00	14	1.50	-	412,456.00	-
华泰证券	2023063000019600	白银有色	2023年6月30日	55,760.00	20,500.00	14	1.50	-	55,760.00	-
华泰证券	2023063000019602	力量钻石	2023年6月30日	48,400.00	1,100.00	14	1.50	-	48,400.00	-
华泰证券	2023063000019626	盛新锂能	2023年6月30日	143,415.00	4,500.00	14	1.50	-	143,415.00	-
华泰证券	2023063000019764	国城矿业	2023年6月30日	34,891.00	2,300.00	14	1.50	-	34,891.00	-
华泰证券	2023063000019935	厦门钨业	2023年6月30日	106,568.00	5,600.00	14	1.50	-	106,568.00	-
华泰证券	2023063000019996	紫金矿业	2023年6月30日	930,066.00	81,800.00	14	1.50	-	930,066.00	-
华泰证券	20230630000	洛阳钼业	2023年6月30日	251,043.00	47,100.00	14	1.50	-	251,043.00	-

	02019 7		月 30 日							
华泰 证券	20230 63000 02027 0	华友 钴业	2023 年 6 月 30 日	394,8 26.00	8,600. 00	14	1.50	-	394,8 26.00	-
华泰 证券	20230 63000 02027 1	宝钛 股份	2023 年 6 月 30 日	64,29 6.00	1,900. 00	14	1.50	-	64,29 6.00	-
华泰 证券	20230 63000 02035 2	金钼 股份	2023 年 6 月 30 日	70,24 5.00	6,300. 00	14	1.50	-	70,24 5.00	-
华泰 证券	20230 63000 02037 0	西部 矿业	2023 年 6 月 30 日	136,6 30.00	13,00 0.00	14	1.50	-	136,6 30.00	-
华泰 证券	20230 63000 02051 9	西藏 珠峰	2023 年 6 月 30 日	91,30 0.00	5,000. 00	14	1.50	-	91,30 0.00	-
华泰 证券	20230 63000 02052 1	金力 永磁	2023 年 6 月 30 日	89,76 0.00	3,000. 00	14	1.50	-	89,76 0.00	-
华泰 证券	20230 63000 02069 8	云铝 股份	2023 年 6 月 30 日	174,4 01.00	13,70 0.00	14	1.50	-	174,4 01.00	-
华泰 证券	20230 63000 02077 8	海亮 股份	2023 年 6 月 30 日	96,08 0.00	8,000. 00	14	1.50	-	96,08 0.00	-
华泰 证券	20230 63000 02083 2	湖南 黄金	2023 年 6 月 30 日	71,98 0.00	5,900. 00	14	1.50	-	71,98 0.00	-
华泰 证券	20230 63000 02088 6	云南 铜业	2023 年 6 月 30 日	90,61 0.00	8,200. 00	14	1.50	-	90,61 0.00	-
华泰 证券	20230 63000	赤峰 黄金	2023 年 6	168,2 50.00	12,50 0.00	14	1.50	-	168,2 50.00	-

	020985		月 30 日							
华泰证券	2023063000021009	天山铝业	2023年6月30日	113,211.00	18,900.00	14	1.50	-	113,211.00	-
华泰证券	2023063000021055	赣锋锂业	2023年6月30日	463,296.00	7,600.00	14	1.50	-	463,296.00	-
华泰证券	2023063000021145	鼎胜新材	2023年6月30日	57,570.00	3,000.00	14	1.50	-	57,570.00	-
华泰证券	2023063000021230	中国稀土	2023年6月30日	115,440.00	3,900.00	14	1.50	-	115,440.00	-
华泰证券	2023063000021331	西藏矿业	2023年6月30日	85,927.00	2,900.00	14	1.50	-	85,927.00	-
华泰证券	2023063000021394	中国铝业	2023年6月30日	295,911.00	53,900.00	14	1.50	-	295,911.00	-
华泰证券	2023063000021407	明泰铝业	2023年6月30日	91,608.00	6,600.00	14	1.50	-	91,608.00	-
华泰证券	2023063000021475	南山铝业	2023年6月30日	147,074.00	48,700.00	14	1.50	-	147,074.00	-
华泰证券	2023063000021489	中金黄金	2023年6月30日	198,336.00	19,200.00	14	1.50	-	198,336.00	-
华泰证券	2023063000021579	盛和资源	2023年6月30日	120,978.00	9,400.00	14	1.50	-	120,978.00	-
华泰证券	20230630000	横店东磁	2023年6月	98,334.00	5,400.00	14	1.50	-	98,334.00	-

	02176 3		月 30 日							
华泰 证券	20230 63000 02176 4	山东 黄金	2023 年 6 月 30 日	265,3 24.00	11,30 0.00	14	1.50	-	265,3 24.00	-
华泰 证券	20230 63000 02176 5	坤彩 科技	2023 年 6 月 30 日	50,00 0.00	1,000. 00	14	1.50	-	50,00 0.00	-
华泰 证券	20230 63000 02180 3	中科 三环	2023 年 6 月 30 日	84,61 2.00	6,600. 00	14	1.50	-	84,61 2.00	-
华泰 证券	20230 63000 02180 4	雅化 集团	2023 年 6 月 30 日	140,4 62.00	7,900. 00	14	1.50	-	140,4 62.00	-
华泰 证券	20230 10300 00067 2	寒锐 钴业	2023 年 1 月 3 日	158,7 69.00	3,900. 00	14	1.80	107.9 0	-	-
华泰 证券	20230 10300 00067 4	金力 永磁	2023 年 1 月 3 日	189,3 78.00	6,300. 00	14	1.80	128.7 0	-	-
华泰 证券	20230 10300 00067 6	腾远 钴业	2023 年 1 月 3 日	84,68 4.00	1,200. 00	14	1.80	57.55	-	-
华泰 证券	20230 10300 00067 7	力量 钻石	2023 年 1 月 3 日	121,6 80.00	1,000. 00	14	1.80	82.70	-	-
华泰 证券	20230 10300 00068 0	天华 新能	2023 年 1 月 3 日	422,0 13.00	7,300. 00	14	1.80	286.8 0	-	-
华泰 证券	20230 10900 03551 8	力量 钻石	2023 年 1 月 9 日	186,0 00.00	1,500. 00	28	1.80	252.8 2	-	-
华泰 证券	20230 10900	金力 永磁	2023 年 1	255,1 70.00	7,900. 00	28	1.80	346.8 3	-	-

	036704		月9日							
华泰证券	2023010900037970	寒锐钴业	2023年1月9日	191,636.00	4,600.00	28	1.80	260.48	-	-
华泰证券	2023011100024061	力量钻石	2023年1月11日	128,300.00	1,000.00	28	3.40	329.40	-	-
华泰证券	2023011200013371	力量钻石	2023年1月12日	4,057,680.00	31,900.00	18	3.50	6,894.12	-	-
华泰证券	2023011700023593	腾远钴业	2023年1月17日	83,172.00	1,200.00	14	1.80	56.52	-	-
华泰证券	2023011700023597	寒锐钴业	2023年1月17日	164,268.00	3,900.00	14	1.80	111.64	-	-
华泰证券	2023011700023601	天华新能	2023年1月17日	447,417.00	7,300.00	14	1.80	304.07	-	-
华泰证券	2023011700024137	金力永磁	2023年1月17日	199,962.00	6,300.00	14	1.80	135.90	-	-
华泰证券	2023011700024141	力量钻石	2023年1月17日	136,290.00	1,000.00	14	1.80	92.62	-	-
华泰证券	2023013000073229	力量钻石	2023年1月30日	4,419,426.00	31,900.00	14	3.50	5,840.13	-	-
华泰证券	2023013100023475	力量钻石	2023年1月31日	139,170.00	1,000.00	14	1.80	94.58	-	-
华泰证券	2023013100013100	天华新能	2023年1月	462,601.00	7,300.00	14	1.80	314.39	-	-

	023527		月 31 日							
华泰证券	2023013100032567	寒锐钴业	2023 年 1 月 31 日	170,742.00	3,900.00	14	1.80	116.04	-	-
华泰证券	2023013100032731	腾远钴业	2023 年 1 月 31 日	85,296.00	1,200.00	14	1.80	57.97	-	-
华泰证券	2023013100033061	金力永磁	2023 年 1 月 31 日	212,688.00	6,300.00	14	1.80	144.55	-	-
华泰证券	2023020800004165	力量钻石	2023 年 2 月 8 日	130,850.00	1,000.00	28	3.40	335.95	-	-
华泰证券	2023021300076552	力量钻石	2023 年 2 月 13 日	4,277,790.00	31,900.00	14	3.50	5,652.96	-	-
华泰证券	2023021400020221	金力永磁	2023 年 2 月 14 日	220,500.00	6,300.00	14	1.80	149.85	-	-
华泰证券	2023021400020223	力量钻石	2023 年 2 月 14 日	137,100.00	1,000.00	14	1.80	93.17	-	-
华泰证券	2023021400022897	寒锐钴业	2023 年 2 月 14 日	173,043.00	3,900.00	14	1.80	117.60	-	-
华泰证券	2023021400028005	天华新能	2023 年 2 月 14 日	440,336.00	7,300.00	14	1.80	299.26	-	-
华泰证券	2023021400030705	腾远钴业	2023 年 2 月 14 日	88,260.00	1,200.00	14	1.80	59.98	-	-
华泰证券	2023022700	力量钻石	2023 年 2 月	3,969,636.00	31,900.00	14	3.50	5,245.74	-	-

	06813 2		月 27 日	0						
华泰 证券	20230 22800 02827 4	腾远 钴业	2023 年 2 月 28 日	86,38 8.00	1,200. 00	14	1.80	58.71	-	-
华泰 证券	20230 22800 02829 0	天华 新能	2023 年 2 月 28 日	419,7 50.00	7,300. 00	14	1.80	285.2 7	-	-
华泰 证券	20230 22800 02829 2	金力 永磁	2023 年 2 月 28 日	202,7 97.00	6,300. 00	14	1.80	137.8 2	-	-
华泰 证券	20230 22800 02834 4	寒锐 钴业	2023 年 2 月 28 日	176,2 41.00	3,900. 00	14	1.80	119.7 8	-	-
华泰 证券	20230 22800 02836 8	力量 钻石	2023 年 2 月 28 日	125,1 70.00	1,000. 00	14	1.80	85.07	-	-
华泰 证券	20230 31300 06137 0	力量 钻石	2023 年 3 月 13 日	3,921, 786.0 0	31,90 0.00	14	3.50	5,182. 51	-	-
华泰 证券	20230 31400 02080 2	寒锐 钴业	2023 年 3 月 14 日	164,0 73.00	3,900. 00	14	1.80	111.5 1	-	-
华泰 证券	20230 31400 02082 0	金力 永磁	2023 年 3 月 14 日	178,8 57.00	6,300. 00	14	1.80	121.5 5	-	-
华泰 证券	20230 31400 02083 4	腾远 钴业	2023 年 3 月 14 日	75,07 2.00	1,200. 00	14	1.80	51.02	-	-
华泰 证券	20230 31400 02095 4	天华 新能	2023 年 3 月 14 日	387,8 49.00	7,300. 00	14	1.80	263.5 9	-	-
华泰 证券	20230 31400	力量 钻石	2023 年 3	117,7 80.00	1,000. 00	14	1.80	80.04	-	-

	020970		月 14 日							
华泰证券	202303270000761	力量钻石	2023年3月27日	195,000.00	2,000.00	14	3.50	257.69	-	-
华泰证券	202303270067515	力量钻石	2023年3月27日	3,110,250.00	31,900.00	14	3.50	4,110.09	-	-
华泰证券	2023032800022001	天华新能	2023年3月28日	378,651.00	7,300.00	14	1.80	257.34	-	-
华泰证券	2023032800022039	寒锐钴业	2023年3月28日	168,558.00	3,900.00	14	1.80	114.55	-	-
华泰证券	2023032800022051	力量钻石	2023年3月28日	97,550.00	1,000.00	14	1.80	66.30	-	-
华泰证券	2023032800022117	金力永磁	2023年3月28日	177,219.00	6,300.00	14	1.80	120.44	-	-
华泰证券	2023032800023379	腾远钴业	2023年3月28日	73,200.00	1,200.00	14	1.80	49.75	-	-
华泰证券	2023041000002149	中国稀土	2023年4月10日	49,616.00	1,400.00	14	3.20	59.95	-	-
华泰证券	2023041000002151	安宁股份	2023年4月10日	50,820.00	1,400.00	14	3.20	61.40	-	-
华泰证券	2023041000002153	永兴材料	2023年4月10日	1,089,280.00	12,800.00	14	3.20	1,316.07	-	-
华泰证券	2023041000002153	国城矿业	2023年4月10日	28,832.00	1,600.00	14	3.20	34.83	-	-

	002155		月10日							
华泰证券	2023041000002157	天齐锂业	2023年4月10日	156,300.00	2,000.00	14	3.20	188.84	-	-
华泰证券	2023041000049587	力量钻石	2023年4月10日	187,580.00	2,000.00	14	3.50	247.88	-	-
华泰证券	2023041000053417	力量钻石	2023年4月10日	2,991,901.00	31,900.00	14	3.50	3,953.70	-	-
华泰证券	2023041100003364	中国稀土	2023年4月11日	2,058,840.00	57,000.00	14	3.20	2,487.49	-	-
华泰证券	2023041100003366	云铝股份	2023年4月11日	202,612.00	14,800.00	14	3.20	244.80	-	-
华泰证券	2023041100017700	天华新能	2023年4月11日	373,614.00	7,300.00	14	1.80	253.91	-	-
华泰证券	2023041100017724	寒锐钴业	2023年4月11日	165,945.00	3,900.00	14	1.80	112.78	-	-
华泰证券	2023041100017730	金力永磁	2023年4月11日	181,251.00	6,300.00	14	1.80	123.18	-	-
华泰证券	2023041100017770	腾远钴业	2023年4月11日	73,500.00	1,200.00	14	1.80	49.95	-	-
华泰证券	2023041100020522	力量钻石	2023年4月11日	93,500.00	1,000.00	14	1.80	63.54	-	-
华泰证券	2023041200	铜陵有色	2023年4月	6,580.00	2,000.00	14	3.20	7.95	-	-

	010918		月12日							
华泰证券	202304120010924	天齐锂业	2023年4月12日	5,392,263.00	68,700.00	14	3.20	6,514.92	-	-
华泰证券	202304120010934	山东黄金	2023年4月12日	2,940,014.00	112,300.00	14	3.20	3,552.12	-	-
华泰证券	202304130003031	山东黄金	2023年4月13日	3,876,691.00	146,900.00	28	3.20	9,367.62	-	-
华泰证券	202304140002051	中国稀土	2023年4月14日	1,159,665.00	31,300.00	14	3.20	1,401.11	-	-
华泰证券	202304170004218	中国稀土	2023年4月17日	80,430.00	2,100.00	17	3.20	118.00	-	-
华泰证券	202304170004219	永兴材料	2023年4月17日	378,430.00	4,100.00	17	3.20	555.19	-	-
华泰证券	202304170004226	宝钛股份	2023年4月17日	367,135.00	10,100.00	17	3.20	538.62	-	-
华泰证券	202304180005605	中国稀土	2023年4月18日	44,640.00	1,200.00	16	3.20	61.64	-	-
华泰证券	202304190004388	力量钻石	2023年4月19日	108,180.00	1,200.00	15	3.50	153.17	-	-
华泰证券	20230420002783	神火股份	2023年4月20日	98,124.00	5,200.00	14	3.20	118.55	-	-
华泰证券	2023042000	天齐锂业	2023年4月	160,400.00	2,000.00	14	3.20	193.36	-	-

	002785		月 20 日							
华泰证券	2023042000002791	雅化集团	2023年 4 月 20 日	763,531.00	37,300.00	28	3.10	1,787.34	-	-
华泰证券	2023042100004634	江西铜业	2023年 4 月 21 日	609,696.00	29,200.00	14	3.20	736.63	-	-
华泰证券	2023042400003835	永兴材料	2023年 4 月 24 日	4,258,800.00	65,000.00	14	3.20	5,145.48	-	-
华泰证券	2023042400003855	江西铜业	2023年 4 月 24 日	200,704.00	9,800.00	14	3.20	242.49	-	-
华泰证券	2023042400013387	中国稀土	2023年 4 月 24 日	47,362.00	1,400.00	14	3.20	57.22	-	-
华泰证券	2023042400014641	国城矿业	2023年 4 月 24 日	30,576.00	1,600.00	14	3.20	36.94	-	-
华泰证券	2023042400016713	力量钻石	2023年 4 月 24 日	2,701,930.00	31,900.00	14	3.50	3,570.51	-	-
华泰证券	2023042400018711	天齐锂业	2023年 4 月 24 日	152,040.00	2,000.00	14	3.20	183.69	-	-
华泰证券	2023042400019323	力量钻石	2023年 4 月 24 日	169,400.00	2,000.00	14	3.50	223.86	-	-
华泰证券	2023042400036965	永兴材料	2023年 4 月 24 日	838,656.00	12,800.00	14	3.20	1,013.26	-	-
华泰证券	2023042400	安宁股份	2023年 4	48,986.00	1,400.00	14	3.20	59.18	-	-

	050893		月 24 日							
华泰证券	202304250003576	寒锐钴业	2023 年 4 月 25 日	378,160.00	11,600.00	14	3.50	499.73	-	-
华泰证券	202304250003578	永兴材料	2023 年 4 月 25 日	1,248,360.00	20,200.00	14	3.20	1,508.27	-	-
华泰证券	202304250003580	天齐锂业	2023 年 4 月 25 日	140,140.00	2,000.00	14	3.20	169.32	-	-
华泰证券	202304250003591	江西铜业	2023 年 4 月 25 日	3,464,600.00	170,000.00	28	3.10	8,110.23	-	-
华泰证券	202304250003607	明泰铝业	2023 年 4 月 25 日	26,760.00	2,000.00	14	3.20	32.33	-	-
华泰证券	202304250003653	西部矿业	2023 年 4 月 25 日	2,538,000.00	200,000.00	28	3.10	5,941.17	-	-
华泰证券	202304250003672	明泰铝业	2023 年 4 月 25 日	1,703,274.00	127,300.00	28	3.10	3,987.17	-	-
华泰证券	2023042500050971	天华新能	2023 年 4 月 25 日	334,924.00	7,300.00	14	1.80	227.62	-	-
华泰证券	2023042500052695	中国稀土	2023 年 4 月 25 日	1,942,560.00	57,000.00	14	3.20	2,347.00	-	-
华泰证券	2023042500053755	腾远钴业	2023 年 4 月 25 日	60,000.00	1,200.00	14	1.80	40.78	-	-
华泰证券	2023042500053755	寒锐钴业	2023 年 4 月 25 日	127,140.00	3,900.00	14	1.80	86.41	-	-

	053783		月 25 日							
华泰证券	202304250056239	力量钻石	2023 年 4 月 25 日	82,980.00	1,000.00	14	1.80	56.39	-	-
华泰证券	202304250061883	金力永磁	2023 年 4 月 25 日	168,273.00	6,300.00	14	1.80	114.36	-	-
华泰证券	202304250062631	云铝股份	2023 年 4 月 25 日	214,008.00	14,800.00	14	3.20	258.56	-	-
华泰证券	202304260003068	腾远钴业	2023 年 4 月 26 日	225,808.00	4,400.00	14	3.50	298.40	-	-
华泰证券	202304260003069	中金岭南	2023 年 4 月 26 日	2,449,926.00	504,100.00	14	3.20	2,960.00	-	-
华泰证券	202304260003078	江西铜业	2023 年 4 月 26 日	3,410,022.00	169,400.00	28	3.10	7,982.47	-	-
华泰证券	202304260003082	西藏珠峰	2023 年 4 月 26 日	44,176.00	2,200.00	14	3.20	53.37	-	-
华泰证券	202304260003084	西部矿业	2023 年 4 月 26 日	2,566,000.00	200,000.00	28	3.10	6,006.71	-	-
华泰证券	202304260003088	盛屯矿业	2023 年 4 月 26 日	2,352,836.00	451,600.00	14	3.20	2,842.69	-	-
华泰证券	202304260007486	铜陵有色	2023 年 4 月 26 日	6,600.00	2,000.00	14	3.20	7.97	-	-
华泰证券	2023042600	山东黄金	2023 年 4	2,835,575.0	112,300.00	14	3.20	3,425.94	-	-

	014586		月 26 日	0						
华泰证券	202304260019690	天齐锂业	2023 年 4 月 26 日	4,898,310.00	68,700.00	14	3.20	5,918.13	-	-
华泰证券	202304270005482	中金岭南	2023 年 4 月 27 日	1,383,340.00	287,000.00	14	3.20	1,671.35	-	-
华泰证券	202304270005558	盛屯矿业	2023 年 4 月 27 日	239,660.00	46,000.00	14	3.20	289.56	-	-
华泰证券	202304280001192	北方稀土	2023 年 4 月 28 日	759,832.00	30,200.00	14	3.20	918.03	-	-
华泰证券	202304280007426	中国稀土	2023 年 4 月 28 日	1,058,253.00	31,300.00	14	3.20	1,278.58	-	-
华泰证券	202305040002815	中金岭南	2023 年 5 月 4 日	95,418.00	18,600.00	14	3.20	115.28	-	-
华泰证券	202305040017813	天齐锂业	2023 年 5 月 4 日	146,320.00	2,000.00	14	3.20	176.78	-	-
华泰证券	202305040032649	永兴材料	2023 年 5 月 4 日	262,400.00	4,100.00	14	3.20	317.03	-	-
华泰证券	202305040034199	力量钻石	2023 年 5 月 4 日	98,316.00	1,200.00	14	3.50	129.92	-	-
华泰证券	202305040045241	神火股份	2023 年 5 月 4 日	81,484.00	5,200.00	14	3.20	98.45	-	-
华泰证券	2023050500	中金岭南	2023 年 5 月 5 日	46,276.00	9,200.00	14	3.20	55.91	-	-

	002028		月 5 日							
华泰证券	202305050002030	安宁股份	2023年 5 月 5 日	35,497.00	1,100.00	14	3.20	42.89	-	-
华泰证券	202305050008161	江西铜业	2023年 5 月 5 日	588,380.00	29,200.00	14	3.20	710.88	-	-
华泰证券	202305080002544	中金岭南	2023年 5 月 8 日	107,520.00	21,000.00	14	3.20	129.91	-	-
华泰证券	2023050800044575	永兴材料	2023年 5 月 8 日	4,143,750.00	65,000.00	14	3.20	5,006.47	-	-
华泰证券	2023050800051137	力量钻石	2023年 5 月 8 日	2,592,513.00	31,900.00	14	3.50	3,425.92	-	-
华泰证券	2023050800054005	安宁股份	2023年 5 月 8 日	45,850.00	1,400.00	14	3.20	55.40	-	-
华泰证券	2023050800057767	国城矿业	2023年 5 月 8 日	28,448.00	1,600.00	14	3.20	34.37	-	-
华泰证券	2023050800062033	永兴材料	2023年 5 月 8 日	816,000.00	12,800.00	14	3.20	985.89	-	-
华泰证券	202305090002298	永兴材料	2023年 5 月 9 日	1,212,900.00	19,500.00	14	3.20	1,465.42	-	-
华泰证券	202305090002307	中金岭南	2023年 5 月 9 日	671,880.00	132,000.00	14	3.20	811.76	-	-
华泰证券	2023050900	金力永磁	2023年 5	172,242.00	6,300.00	14	1.80	117.06	-	-

	01174 9		月 9 日								
华泰 证券	20230 50900 01358 5	天华 新能	2023 年 5 月 9 日	239,5 86.00	7,300. 00	14	1.80	162.8 3	-	-	
华泰 证券	20230 50900 02112 7	腾远 钴业	2023 年 5 月 9 日	61,20 0.00	1,200. 00	14	1.80	41.59	-	-	
华泰 证券	20230 50900 02121 1	寒锐 钴业	2023 年 5 月 9 日	129,2 46.00	3,900. 00	14	1.80	87.84	-	-	
华泰 证券	20230 50900 02186 5	中国 稀土	2023 年 5 月 9 日	1,914, 630.0 0	57,00 0.00	14	3.20	2,313. 25	-	-	
华泰 证券	20230 50900 02187 3	力量 钻石	2023 年 5 月 9 日	79,86 0.00	1,000. 00	14	1.80	54.27	-	-	
华泰 证券	20230 50900 02523 3	天齐 锂业	2023 年 5 月 9 日	142,3 40.00	2,000. 00	14	3.20	171.9 7	-	-	
华泰 证券	20230 50900 02528 1	永兴 材料	2023 年 5 月 9 日	1,256, 440.0 0	20,20 0.00	14	3.20	1,518. 03	-	-	
华泰 证券	20230 50900 02647 3	云铝 股份	2023 年 5 月 9 日	203,0 56.00	14,80 0.00	14	3.20	245.3 3	-	-	
华泰 证券	20230 51000 00359 6	铜陵 有色	2023 年 5 月 10 日	104,6 40.00	32,70 0.00	14	3.20	126.4 3	-	-	
华泰 证券	20230 51000 00359 7	中金 岭南	2023 年 5 月 10 日	365,7 60.00	72,00 0.00	14	3.20	441.9 1	-	-	
华泰 证券	20230 51000	西部 矿业	2023 年 5	6,131, 444.0	463,1 00.00	14	3.20	7,408. 00	-	-	

	003609		月 10 日	0						
华泰证券	2023051000003613	明泰铝业	2023年 5 月 10 日	863,655.00	64,500.00	14	3.20	1,043.47	-	-
华泰证券	2023051000009452	西藏珠峰	2023年 5 月 10 日	43,230.00	2,200.00	14	3.20	52.23	-	-
华泰证券	2023051000009454	盛屯矿业	2023年 5 月 10 日	2,411,544.00	451,600.00	14	3.20	2,913.62	-	-
华泰证券	2023051000009462	中金岭南	2023年 5 月 10 日	2,560,828.00	504,100.00	14	3.20	3,093.99	-	-
华泰证券	2023051000025198	山东黄金	2023年 5 月 10 日	2,849,051.00	112,300.00	14	3.20	3,442.22	-	-
华泰证券	2023051000025240	铜陵有色	2023年 5 月 10 日	6,400.00	2,000.00	14	3.20	7.73	-	-
华泰证券	2023051000028132	腾远钴业	2023年 5 月 10 日	231,660.00	4,400.00	14	3.50	306.13	-	-
华泰证券	2023051100002156	中国稀土	2023年 5 月 11 日	564,300.00	17,100.00	14	3.20	681.79	-	-
华泰证券	2023051100002198	宝钛股份	2023年 5 月 11 日	228,900.00	7,000.00	14	3.20	276.56	-	-
华泰证券	2023051100002216	西藏珠峰	2023年 5 月 11 日	273,516.00	13,800.00	14	3.20	330.46	-	-
华泰证券	2023051100	中金岭南	2023年 5 月	1,446,480.00	287,000.00	14	3.20	1,747.63	-	-

	021717		月 11 日	0							
华泰证券	202305110021823	盛屯矿业	2023年 5 月 11 日	245,180.00	46,000.00	14	3.20	296.23	-	-	
华泰证券	202305120001255	宝钛股份	2023年 5 月 12 日	510,080.00	16,000.00	14	3.20	616.28	-	-	
华泰证券	202305120006064	北方稀土	2023年 5 月 12 日	737,484.00	30,200.00	14	3.20	891.03	-	-	
华泰证券	202305120007326	中国稀土	2023年 5 月 12 日	995,340.00	31,300.00	14	3.20	1,202.57	-	-	
华泰证券	202305150002614	中国稀土	2023年 5 月 15 日	2,191,140.00	66,600.00	14	3.20	2,647.33	-	-	
华泰证券	202305150002617	神火股份	2023年 5 月 15 日	4,617,000.00	300,000.00	14	3.20	5,578.25	-	-	
华泰证券	202305160001439	神火股份	2023年 5 月 16 日	53,585.00	3,500.00	14	3.20	64.74	-	-	
华泰证券	202305160001440	赣锋锂业	2023年 5 月 16 日	103,620.00	1,500.00	14	3.20	125.19	-	-	
华泰证券	202305160001441	融捷股份	2023年 5 月 16 日	339,975.00	4,500.00	14	3.20	410.76	-	-	
华泰证券	202305170003964	神火股份	2023年 5 月 17 日	24,064.00	1,600.00	14	3.20	29.07	-	-	
华泰证券	2023051800	西藏珠峰	2023年 5 月	410,340.00	21,000.00	14	3.20	495.77	-	-	

	001773		月 18 日							
华泰证券	2023051800006900	永兴材料	2023年5月18日	290,690.00	4,100.00	14	3.20	351.21	-	-
华泰证券	2023051800017520	天齐锂业	2023年5月18日	162,000.00	2,000.00	14	3.20	195.73	-	-
华泰证券	2023051800025116	神火股份	2023年5月18日	72,332.00	5,200.00	14	3.20	87.39	-	-
华泰证券	2023051800031660	力量钻石	2023年5月18日	96,012.00	1,200.00	14	3.50	126.88	-	-
华泰证券	2023051800037840	中金岭南	2023年5月18日	91,512.00	18,600.00	14	3.20	110.56	-	-
华泰证券	2023051900003503	神火股份	2023年5月19日	27,320.00	2,000.00	14	3.20	33.01	-	-
华泰证券	2023051900003512	西藏珠峰	2023年5月19日	279,504.00	14,400.00	14	3.20	337.70	-	-
华泰证券	2023051900008657	中金岭南	2023年5月19日	44,804.00	9,200.00	14	3.20	54.13	-	-
华泰证券	2023051900012647	江西铜业	2023年5月19日	559,180.00	29,200.00	14	3.20	675.60	-	-
华泰证券	2023051900013111	安宁股份	2023年5月19日	36,674.00	1,100.00	14	3.20	44.31	-	-
华泰证券	2023052200	安宁股份	2023年5月	46,788.00	1,400.00	14	3.20	56.53	-	-

	01713 6		月 22 日								
华泰 证券	20230 52200 01862 8	永兴 材料	2023 年 5 月 22 日	897,7 92.00	12,80 0.00	14	3.20	1,084. 71	-	-	
华泰 证券	20230 52200 01891 8	力量 钻石	2023 年 5 月 22 日	2,634, 302.0 0	31,90 0.00	14	3.50	3,481. 14	-	-	
华泰 证券	20230 52200 03843 6	中金 岭南	2023 年 5 月 22 日	101,8 50.00	21,00 0.00	14	3.20	123.0 6	-	-	
华泰 证券	20230 52200 04007 6	国城 矿业	2023 年 5 月 22 日	26,86 4.00	1,600. 00	14	3.20	32.46	-	-	
华泰 证券	20230 52200 05733 8	永兴 材料	2023 年 5 月 22 日	4,559, 100.0 0	65,00 0.00	14	3.20	5,508. 30	-	-	
华泰 证券	20230 52300 00455 9	坤彩 科技	2023 年 5 月 23 日	95,76 1.00	1,700. 00	14	3.20	115.7 0	-	-	
华泰 证券	20230 52300 01728 8	永兴 材料	2023 年 5 月 23 日	1,436, 220.0 0	20,20 0.00	14	3.20	1,735. 24	-	-	
华泰 证券	20230 52300 01729 0	天华 新能	2023 年 5 月 23 日	260,1 72.00	7,300. 00	14	1.80	176.8 2	-	-	
华泰 证券	20230 52300 01731 6	云铝 股份	2023 年 5 月 23 日	185,0 00.00	14,80 0.00	14	3.20	223.5 2	-	-	
华泰 证券	20230 52300 01824 0	永兴 材料	2023 年 5 月 23 日	1,386, 450.0 0	19,50 0.00	14	3.20	1,675. 11	-	-	
华泰 证券	20230 52300	中金 岭南	2023 年 5	623,0 40.00	132,0 00.00	14	3.20	752.7 6	-	-	

	01824 4		月 23 日								
华泰 证券	20230 52300 01840 0	金力 永磁	2023 年 5 月 23 日	169,0 92.00	6,300. 00	14	1.80	114.9 2	-	-	
华泰 证券	20230 52300 01946 0	腾远 钴业	2023 年 5 月 23 日	63,26 4.00	1,200. 00	14	1.80	42.99	-	-	
华泰 证券	20230 52300 02077 4	寒锐 钴业	2023 年 5 月 23 日	134,1 60.00	3,900. 00	14	1.80	91.18	-	-	
华泰 证券	20230 52300 02085 8	中国 稀土	2023 年 5 月 23 日	1,807, 470.0 0	57,00 0.00	14	3.20	2,183. 78	-	-	
华泰 证券	20230 52300 02577 0	力量 钻石	2023 年 5 月 23 日	81,96 0.00	1,000. 00	14	1.80	55.70	-	-	
华泰 证券	20230 52400 00268 2	中金 岭南	2023 年 5 月 24 日	184,5 36.00	39,60 0.00	14	3.20	222.9 6	-	-	
华泰 证券	20230 52400 00447 8	中金 岭南	2023 年 5 月 24 日	335,5 20.00	72,00 0.00	14	3.20	405.3 7	-	-	
华泰 证券	20230 52400 00448 4	铜陵 有色	2023 年 5 月 24 日	94,50 3.00	32,70 0.00	14	3.20	114.1 8	-	-	
华泰 证券	20230 52400 00449 2	铜陵 有色	2023 年 5 月 24 日	5,780. 00	2,000. 00	14	3.20	6.98	-	-	
华泰 证券	20230 52400 00455 4	中金 岭南	2023 年 5 月 24 日	2,349, 106.0 0	504,1 00.00	14	3.20	2,838. 19	-	-	
华泰 证券	20230 52400	山东 黄金	2023 年 5	2,752, 473.0	112,3 00.00	14	3.20	3,325. 53	-	-	

	013638		月 24 日	0						
华泰证券	202305240015742	西部矿业	2023年 5 月 24 日	4,936,646.00	463,100.00	14	3.20	5,964.45	-	-
华泰证券	202305240015744	明泰铝业	2023年 5 月 24 日	839,145.00	64,500.00	14	3.20	1,013.85	-	-
华泰证券	202305240021504	西藏珠峰	2023年 5 月 24 日	41,514.00	2,200.00	14	3.20	50.16	-	-
华泰证券	202305240021506	盛屯矿业	2023年 5 月 24 日	2,312,192.00	451,600.00	14	3.20	2,793.59	-	-
华泰证券	202305250003010	中矿资源	2023年 5 月 25 日	1,544,000.00	20,000.00	14	3.20	1,865.46	-	-
华泰证券	202305260012381	北方稀土	2023年 5 月 26 日	721,780.00	30,200.00	14	3.20	872.05	-	-
华泰证券	202306060016323	力量钻石	2023年 6 月 6 日	78,400.00	1,000.00	14	1.80	53.28	-	-
华泰证券	202306060016406	金力永磁	2023年 6 月 6 日	171,045.00	6,300.00	14	1.80	116.24	-	-
华泰证券	202306060018054	天华新能	2023年 6 月 6 日	262,800.00	7,300.00	14	1.80	178.60	-	-
华泰证券	202306060018161	腾远钴业	2023年 6 月 6 日	62,928.00	1,200.00	14	1.80	42.77	-	-
华泰证券	2023060800	中矿资源	2023年 6 月	1,113,200.00	20,000.00	18	3.20	1,729.24	-	-

	022420		月 8 日	0						
华泰证券	202306090009067	北方稀土	2023年6月9日	721,780.00	30,200.00	17	3.20	1,058.92	-	-
华泰证券	202306140028065	中矿资源	2023年6月14日	443,040.00	8,000.00	14	3.20	535.28	-	-
华泰证券	202306160011654	腾远钴业	2023年6月16日	38,410.00	1,000.00	14	1.50	21.75	-	-
华泰证券	202306160011656	天齐锂业	2023年6月16日	501,732.00	6,600.00	14	1.50	284.15	-	-
华泰证券	202306160011657	金力永磁	2023年6月16日	80,610.00	3,000.00	14	1.50	45.65	-	-
华泰证券	202306160011658	中矿资源	2023年6月16日	228,000.00	4,000.00	14	1.50	129.13	-	-
华泰证券	202306160011662	海亮股份	2023年6月16日	96,320.00	8,000.00	14	1.50	54.55	-	-
华泰证券	202306160011664	云铝股份	2023年6月16日	188,375.00	13,700.00	14	1.50	106.68	-	-
华泰证券	202306160011665	永兴材料	2023年6月16日	145,178.00	2,200.00	14	1.50	82.22	-	-
华泰证券	202306160011666	力量钻石	2023年6月16日	47,674.00	1,100.00	14	1.50	27.00	-	-
华泰证券	202306160011666	盛新锂能	2023年6月	153,225.00	4,500.00	14	1.50	86.78	-	-

	011667		月 16 日								
华泰证券	2023061600011668	赣锋锂业	2023年 6 月 16 日	496,356.00	7,600.00	14	1.50	281.11	-	-	
华泰证券	2023061600011669	湖南黄金	2023年 6 月 16 日	80,122.00	5,900.00	14	1.50	45.38	-	-	
华泰证券	2023061600011670	中科三环	2023年 6 月 16 日	79,200.00	6,600.00	14	1.50	44.85	-	-	
华泰证券	2023061600011671	中金岭南	2023年 6 月 16 日	87,531.00	17,900.00	14	1.50	49.57	-	-	
华泰证券	2023061600011672	雅化集团	2023年 6 月 16 日	149,152.00	7,900.00	14	1.50	84.47	-	-	
华泰证券	2023061600011673	银泰黄金	2023年 6 月 16 日	144,786.00	11,800.00	14	1.50	82.00	-	-	
华泰证券	2023061600011675	横店东磁	2023年 6 月 16 日	95,634.00	5,400.00	14	1.50	54.16	-	-	
华泰证券	2023061600011679	云南铜业	2023年 6 月 16 日	92,496.00	8,200.00	14	1.50	52.38	-	-	
华泰证券	2023061600011681	融捷股份	2023年 6 月 16 日	102,032.00	1,400.00	14	1.50	57.79	-	-	
华泰证券	2023061600011683	国城矿业	2023年 6 月 16 日	37,237.00	2,300.00	14	1.50	21.09	-	-	
华泰证券	2023061600	锡业股份	2023年 6	103,917.00	6,700.00	14	1.50	58.85	-	-	

	011685		月 16 日							
华泰证券	2023061600011690	中国稀土	2023年 6 月 16 日	121,212.00	3,900.00	14	1.50	68.65	-	-
华泰证券	2023061600011691	天山铝业	2023年 6 月 16 日	123,606.00	18,900.00	14	1.50	70.00	-	-
华泰证券	2023061600011692	铜陵有色	2023年 6 月 16 日	149,184.00	50,400.00	14	1.50	84.49	-	-
华泰证券	2023061600011694	天华新能	2023年 6 月 16 日	150,798.00	4,100.00	14	1.50	85.40	-	-
华泰证券	2023061600011696	南山铝业	2023年 6 月 16 日	149,509.00	48,700.00	14	1.50	84.67	-	-
华泰证券	2023061600011697	神火股份	2023年 6 月 16 日	151,800.00	11,000.00	14	1.50	85.97	-	-
华泰证券	2023061600011698	西藏矿业	2023年 6 月 16 日	89,726.00	2,900.00	14	1.50	50.82	-	-
华泰证券	2023061600011716	北方稀土	2023年 6 月 16 日	417,444.00	17,200.00	14	1.50	236.42	-	-
华泰证券	2023061600011719	白银有色	2023年 6 月 16 日	56,785.00	20,500.00	14	1.50	32.16	-	-
华泰证券	2023061600011724	厦门钨业	2023年 6 月 16 日	108,304.00	5,600.00	14	1.50	61.34	-	-
华泰证券	2023061600	西藏珠峰	2023年 6 月 16 日	91,650.00	5,000.00	14	1.50	51.91	-	-

	01172 6		月 16 日								
华泰 证券	20230 61600 01173 2	紫金 矿业	2023 年 6 月 16 日	984,0 54.00	81,80 0.00	14	1.50	557.3 1	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01173 3	鼎胜 新材	2023 年 6 月 16 日	58,17 0.00	3,000. 00	14	1.50	32.94	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01173 4	华友 钴业	2023 年 6 月 16 日	406,7 80.00	8,600. 00	14	1.50	230.3 8	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01173 8	中国 铝业	2023 年 6 月 16 日	315,3 15.00	53,90 0.00	14	1.50	178.5 8	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01173 9	赤峰 黄金	2023 年 6 月 16 日	180,2 50.00	12,50 0.00	14	1.50	102.0 8	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01174 2	石英 股份	2023 年 6 月 16 日	131,3 40.00	1,200. 00	14	1.50	74.38	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01174 3	金钼 股份	2023 年 6 月 16 日	70,93 8.00	6,300. 00	14	1.50	40.18	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01174 6	明泰 铝业	2023 年 6 月 16 日	90,15 6.00	6,600. 00	14	1.50	51.06	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01174 7	宝钛 股份	2023 年 6 月 16 日	62,98 5.00	1,900. 00	14	1.50	35.67	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01175 0	驰宏 锌锗	2023 年 6 月 16 日	129,3 60.00	24,50 0.00	14	1.50	73.26	-	-	
华泰 证券	20230 61600	西部 矿业	2023 年 6	142,6 10.00	13,00 0.00	14	1.50	80.77	-	-	

	01175 1		月 16 日								
华泰 证券	20230 61600 01175 4	盛屯 矿业	2023 年 6 月 16 日	102,4 53.00	21,30 0.00	14	1.50	58.02	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01175 5	盛和 资源	2023 年 6 月 16 日	122,6 70.00	9,400. 00	14	1.50	69.47	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01175 8	洛阳 钼业	2023 年 6 月 16 日	266,5 86.00	47,10 0.00	14	1.50	150.9 8	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01175 9	山东 黄金	2023 年 6 月 16 日	270,2 96.00	11,30 0.00	14	1.50	153.0 8	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01176 2	中金 黄金	2023 年 6 月 16 日	201,4 08.00	19,20 0.00	14	1.50	114.0 7	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01176 4	东阳 光	2023 年 6 月 16 日	72,72 6.00	10,20 0.00	14	1.50	41.19	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01176 6	坤彩 科技	2023 年 6 月 16 日	52,90 0.00	1,000. 00	14	1.50	29.96	-	-	
华泰 证券	20230 61600 01176 8	江西 铜业	2023 年 6 月 16 日	137,1 01.00	7,100. 00	14	1.50	77.65	-	-	
华泰 证券	20230 61900 00632 0	永兴 材料	2023 年 6 月 19 日	176,0 67.00	2,700. 00	14	3.20	167.1 4	169,0 47.00	172.1 5	
华泰 证券	20230 61900 00632 8	明泰 铝业	2023 年 6 月 19 日	162,2 40.00	12,00 0.00	14	3.20	154.0 1	166,5 60.00	158.6 3	
华泰 证券	20230 61900	盛屯 矿业	2023 年 6	2,312, 970.0	489,0 00.00	14	3.20	2,195. 70	2,376, 540.0	2,261. 57	

	00633 0		月 19 日	0					0	
华泰 证券	20230 62000 02335 2	明泰 铝业	2023 年 6 月 20 日	26,70 0.00	2,000. 00	14	3.20	23.04	27,76 0.00	23.73
华泰 证券	20230 62000 02335 4	盛屯 矿业	2023 年 6 月 20 日	1,069, 170.0 0	227,0 00.00	14	3.20	922.6 9	1,103, 220.0 0	950.3 7
华泰 证券	20230 62000 02336 0	西藏 珠峰	2023 年 6 月 20 日	31,44 6.00	1,800. 00	14	3.20	27.14	32,86 8.00	27.95
华泰 证券	20230 62000 02336 2	鼎胜 新材	2023 年 6 月 20 日	188,1 95.00	9,500. 00	14	3.20	162.4 1	182,3 05.00	167.2 8
华泰 证券	20230 62000 03480 1	力量 钻石	2023 年 6 月 20 日	43,38 0.00	1,000. 00	14	1.80	21.06	44,00 0.00	21.69
华泰 证券	20230 62000 03494 7	金力 永磁	2023 年 6 月 20 日	172,8 72.00	6,300. 00	14	1.80	83.92	188,4 96.00	86.44
华泰 证券	20230 62000 03545 6	腾远 钴业	2023 年 6 月 20 日	44,95 2.00	1,200. 00	14	1.80	21.82	44,83 2.00	22.48
华泰 证券	20230 62000 03654 7	天华 新能	2023 年 6 月 20 日	261,4 13.00	7,300. 00	14	1.80	126.9 0	261,3 40.00	130.7 1
华泰 证券	20230 62100 00593 0	力量 钻石	2023 年 6 月 21 日	278,7 84.00	6,600. 00	14	3.50	236.8 3	290,4 00.00	243.9 4
华泰 证券	20230 62100 00593 2	鼎胜 新材	2023 年 6 月 21 日	166,6 85.00	8,500. 00	14	3.20	129.4 6	163,1 15.00	133.3 5
华泰 证券	20230 62100	盛屯 矿业	2023 年 6	42,12 0.00	9,000. 00	14	3.20	32.71	43,74 0.00	33.70

	005938		月 21 日							
华泰证券	202306260001397	西藏珠峰	2023年6月26日	26,624.00	1,600.00	14	3.20	9.19	29,216.00	9.47
华泰证券	202306260001948	鼎胜新材	2023年6月26日	1,351,700.00	70,000.00	14	3.20	466.61	1,343,300.00	480.60
华泰证券	202306260001950	石英股份	2023年6月26日	589,960.00	5,600.00	14	3.20	203.65	637,504.00	209.76
华泰证券	2023062600043064	北方稀土	2023年6月26日	710,908.00	30,200.00	14	3.20	245.41	724,196.00	252.77
华泰证券	2023062600051276	中矿资源	2023年6月26日	1,031,800.00	20,000.00	14	3.20	356.18	1,018,800.00	366.86
华泰证券	2023062700008377	腾远钴业	2023年6月27日	99,441.00	2,700.00	14	3.50	28.16	100,872.00	29.00
华泰证券	2023062700008385	南山铝业	2023年6月27日	18,180.00	6,000.00	14	3.20	4.71	18,120.00	4.85
华泰证券	2023062700008387	鼎胜新材	2023年6月27日	152,640.00	8,000.00	14	3.20	39.52	153,520.00	40.70
华泰证券	2023062800004450	华友钴业	2023年6月28日	13,743,000.00	300,000.00	14	3.50	2,594.42	13,773,000.00	2,672.25
华泰证券	2023062800004481	西藏珠峰	2023年6月28日	342,846.00	18,900.00	7	3.30	61.02	345,114.00	62.86
华泰证券	2023062800	西藏珠峰	2023年6月	1,088,400.00	60,000.00	14	3.20	187.86	1,095,600.00	193.49

	004485		月 28 日	0					0	
华泰证券	2023062800052480	中矿资源	2023年6月28日	406,400.00	8,000.00	14	3.20	70.14	407,520.00	72.25
华泰证券	20230630001666	中科三环	2023年6月30日	543,568.00	42,400.00	14	3.20	-	543,568.00	-
华泰证券	202306300018554	东阳光	2023年6月30日	73,542.00	10,200.00	14	1.50	-	73,542.00	-
华泰证券	202306300018645	天齐锂业	2023年6月30日	461,406.00	6,600.00	14	1.50	-	461,406.00	-
华泰证券	202306300018677	银泰黄金	2023年6月30日	138,060.00	11,800.00	14	1.50	-	138,060.00	-
华泰证券	202306300018678	盛屯矿业	2023年6月30日	103,518.00	21,300.00	14	1.50	-	103,518.00	-
华泰证券	202306300018817	中矿资源	2023年6月30日	203,760.00	4,000.00	14	1.50	-	203,760.00	-
华泰证券	202306300018899	驰宏锌锗	2023年6月30日	122,990.00	24,500.00	14	1.50	-	122,990.00	-
兴业证券	202304170004230	紫金矿业	2023年4月17日	7,433,504.00	534,400.00	28	3.50	19,646.26	-	-
兴业证券	202305150002610	天齐锂业	2023年5月15日	476,644.00	5,800.00	14	3.50	629.87	-	-

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:)	出借期限 (单位:)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	4,386,609.00	0.11%	1,771,682.00	0.06%
南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1,528,137,468.00	39.60%	1,371,912,568.00	50.12%

注：中证申万有色金属 ETF 联接基金和华泰证券投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中国工商银行	17,386,982.47	11,043.17	5,976,153.97	18,110.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

##### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额

华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	2,604	341,410.44
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	6,790	548,632.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

##### 6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.8 期末(2023 年 06 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

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
688502	茂莱光学	2023 年 2 月 28 日	6 个月	新股锁定期	69.72	178.59	1,509	105,207.48	269,492.31	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定期	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
301488	豪恩光电	2023	1 个月	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-

		年 6 月 26 日	内(含)	上市						
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定期	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定期	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定期	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定期	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定期	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定期	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股锁定期	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定期	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定期	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023年6月20日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	122.11	72	-	8,791.92	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定期	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定期	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定期	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定期	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定期	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	1-6个月(含)	锁定期转增	-	53.24	131	-	6,974.44	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定期	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定期	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
688478	晶升股份	2023年4月	6个月	新股锁定期	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-

		13 日								
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023	6 个月	新股锁	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-

		年 6 月 8 日		定期						
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	10.36	11.84	802	8,308.72	9,495.68	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-

603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定期	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定期	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定期	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定期	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定期	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

## 6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 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

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位股)	期末估值总额
1	603799	华友钴业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	45.91	900,800.00	41,355,728.00
2	002738	中矿资源	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	50.94	410,400.00	20,905,776.00
3	603688	石英股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	113.84	154,400.00	17,576,896.00
4	600711	盛屯矿业	2023 年 7	4.86	2,431,200.0	11,815,632.

			月 3 日 -2023 年 7 月 14 日		0	00
5	300390	天华新能	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	35.80	269,800.00	9,658,840.0 0
6	000970	中科三环	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	12.82	696,900.00	8,934,258.0 0
7	600392	盛和资源	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	12.87	556,600.00	7,163,442.0 0
8	002466	天齐锂业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 28 日	69.91	94,300.00	6,592,513.0 0
9	601677	明泰铝业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	13.88	469,900.00	6,522,212.0 0
10	603826	坤彩科技	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	50.00	120,100.00	6,005,000.0 0
11	002192	融捷股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	66.83	89,200.00	5,961,236.0 0
12	301071	力量钻石	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	44.00	132,900.00	5,847,600.0 0
13	601899	紫金矿业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	11.37	410,300.00	4,665,111.0 0
14	002756	永兴材料	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	62.61	73,200.00	4,583,052.0 0
15	603876	鼎胜新材	2023 年 7	19.19	232,600.00	4,463,594.0

			月 3 日 -2023 年 7 月 14 日			0
16	000762	西藏矿业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	29.63	147,800.00	4,379,314.0 0
17	000807	云铝股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	12.73	264,500.00	3,367,085.0 0
18	601958	金钼股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	11.15	299,100.00	3,334,965.0 0
19	600456	宝钛股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	33.84	91,700.00	3,103,128.0 0
20	002532	天山铝业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	5.99	494,000.00	2,959,060.0 0
21	600111	北方稀土	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 25 日	23.98	120,800.00	2,896,784.0 0
22	600489	中金黄金	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	10.33	280,200.00	2,894,466.0 0
23	002497	雅化集团	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	17.78	143,900.00	2,558,542.0 0
24	002460	赣锋锂业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	60.96	36,300.00	2,212,848.0 0
25	600338	西藏珠峰	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	18.26	120,300.00	2,196,678.0 0
26	000688	国城矿业	2023 年 7	15.17	143,600.00	2,178,412.0

			月 4 日 -2023 年 7 月 14 日			0
27	000831	中国稀土	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	29.60	72,900.00	2,157,840.0 0
28	000933	神火股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	13.00	149,000.00	1,937,000.0 0
29	000975	银泰黄金	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	11.70	154,000.00	1,801,800.0 0
30	600988	赤峰黄金	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	13.46	129,100.00	1,737,686.0 0
31	601600	中国铝业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	5.49	279,900.00	1,536,651.0 0
32	600547	山东黄金	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	23.48	61,800.00	1,451,064.0 0
33	603993	洛阳钼业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	5.33	255,200.00	1,360,216.0 0
34	000060	中金岭南	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	4.75	238,500.00	1,132,875.0 0
35	600219	南山铝业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	3.02	329,100.00	993,882.00
36	000960	锡业股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	15.55	58,200.00	905,010.00
37	600362	江西铜业	2023 年 7	18.98	36,200.00	687,076.00

			月 4 日 -2023 年 7 月 14 日			
38	600497	驰宏锌锗	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	5.02	126,900.00	637,038.00
39	002240	盛新锂能	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	31.87	19,300.00	615,091.00
40	002203	海亮股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	12.01	49,000.00	588,490.00
41	600549	厦门钨业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	19.03	30,700.00	584,221.00
42	000630	铜陵有色	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	2.89	181,500.00	524,535.00
43	601168	西部矿业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	10.51	46,900.00	492,919.00
44	000878	云南铜业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	11.05	39,600.00	437,580.00
45	002056	横店东磁	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	18.21	19,900.00	362,379.00
46	601212	白银有色	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	2.72	104,800.00	285,056.00
47	300748	金力永磁	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	29.92	9,300.00	278,256.00
48	600673	东阳光	2023 年 7	7.21	37,000.00	266,770.00

			月 4 日 -2023 年 7 月 14 日			
49	301219	腾远钴业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	37.36	4,900.00	183,064.00
50	002155	湖南黄金	2023 年 7 月 14 日	12.20	5,900.00	71,980.00
合计	-	-	-	-	11,624,400. 00	215,160,65 1.00

## 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

本基金是被动式指数基金，紧密跟踪中证申万有色金属指数，具有与中证申万有色金属指数以及中证申万有色金属指数所代表的股票市场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。本基金以中证申万有色金属指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证申万有色金属指数，以完全按照中证申万有色金属指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据中证申万有色金属指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与中证申万有色金属指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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，将风险控制可在可承受的范围内。

### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行,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均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,本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券,本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。信用等级评估以内部信用评级为主,外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险,以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外,本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。

### 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来自调整基金投资组合时,由于部分成份股流动性差,导致本基金难以及时完成组合调整,或承受较大市场冲击成本,从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的投资股指期货,以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

#### 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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%。

同时，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逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,386,982.47	-	-	-	17,386,982.47
结算备付金	3,694,534.38	-	-	-	3,694,534.38
存出保证金	375,684.71	-	-	287,558.40	663,243.11
交易性金融	-	-	-	3,982,199.27	3,982,199.27

资产				5.29	5.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	272,120.32	272,120.32
应收股利	-	-	-	256,811.99	256,811.99
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	94,394.59	94,394.59
资产总计	21,457,201.56	-	-	3,983,110.160.59	4,004,567.362.15
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	12,360,099.77	12,360,099.77
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,603,877.77	1,603,877.77
应付托管费	-	-	-	320,775.54	320,775.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	12,595.35	12,595.35
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,697,947.61	3,697,947.61
负债总计	-	-	-	17,995,296.04	17,995,296.04

利率敏感度缺口	21,457,201.56	-	-	3,965,114,864.55	3,986,572,066.11
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,171,265.95	-	-	-	2,171,265.95
结算备付金	2,270,137.41	-	-	-	2,270,137.41
存出保证金	229,524.67	-	-	375,936.00	605,460.67
交易性金融资产	-	-	-	2,909,054,721.54	2,909,054,721.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,159,274.24	1,159,274.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	88,052.98	88,052.98
资产总计	4,670,928.03	-	-	2,910,677,984.76	2,915,348,912.79
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	779,774.62	779,774.62
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,277,217.24	1,277,217.24
应付托管费	-	-	-	255,443.46	255,443.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	11,586.86	11,586.86
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,790,730.36	1,790,730.36
负债总计	-	-	-	4,114,752.54	4,114,752.54
利率敏感度缺口	4,670,928.03	-	-	2,906,563.23 2.22	2,911,234.16 0.25

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：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
	2. 市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，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。

本基金采用完全复制法，跟踪中证申万有色金属指数，以完全按照中证申万有色金属指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，在建仓完成后，本基金 80%以上的基金资产投资于股票（含存托凭证）。本基金投资于中证申万有色金属指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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，来测试本基金面临的潜在价格风险，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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	3,982,199,275.29	99.89	2,909,054,721.54	99.93
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	3,982,199,275.29	99.89	2,909,054,721.54	99.93

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 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：人民币元）	
		本期末( 2023 年 6 月 30 日 )	上年度末( 2022 年 12 月 31 日 )
	1.组合自身基准上升 5%	198,283,267.77	144,812,263.38
	2.组合自身基准下降 5%	-198,283,267.77	-144,812,263.38

#### 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	3,980,002,955.71
第二层次	610,383.14

第三层次	1,585,936.44
合计	3,982,199,275.29

#### 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股票和债券，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股票和债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，确定相关股票和债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 2023 年 06 月 30 日，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

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,982,199,275.29	99.44
	其中：股票	3,982,199,275.29	99.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	21,081,516.85	0.53

8	其他资产	1,286,570.01	0.03
9	合计	4,004,567,362.15	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值；

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 215,160,651.00 元，占基金资产净值的比例为 5.40%。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资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	1,335,592,293.11	33.50
C	制造业	2,607,477,155.95	65.41
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	36,933,239.42	0.93
	合计	3,980,002,688.48	99.84

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	1,935,647.37	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	8,140.64	0.00

F	批发和零售业	69,029.20	0.00
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	102,137.56	0.00
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	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,196,319.58	0.06

### 7.2.3 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。

## 7.3 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

### 7.3.1 报告期末指数投资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

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	601899	紫金矿业	36,410,362	413,985,815.94	10.38
2	002466	天齐锂业	3,513,400	245,621,794.00	6.16
3	002460	赣锋锂业	3,838,066	233,968,503.36	5.87
4	600111	北方稀土	8,607,622	206,410,775.56	5.18
5	603799	华友钴业	4,348,968	199,661,120.88	5.01
6	601600	中国铝业	26,972,027	148,076,428.23	3.71
7	600547	山东黄金	6,146,171	144,312,095.08	3.62
8	603993	洛阳钼业	24,033,146	128,096,668.18	3.21
9	600489	中金黄金	9,890,274	102,166,530.42	2.56
10	002738	中矿资源	1,944,172	99,036,121.68	2.48
11	000807	云铝股份	7,078,085	90,104,022.05	2.26
12	600988	赤峰黄金	5,661,408	76,202,551.68	1.91
13	000630	铜陵有色	25,064,400	72,436,116.00	1.82
14	600219	南山铝业	23,892,613	72,155,691.26	1.81
15	300390	天华新能	1,990,920	71,274,936.00	1.79
16	603688	石英股份	612,924	69,775,268.16	1.75
17	002497	雅化集团	3,920,528	69,706,987.84	1.75

18	000933	神火股份	5,358,600	69,661,800.00	1.75
19	002240	盛新锂能	2,169,600	69,145,152.00	1.73
20	002756	永兴材料	1,103,220	69,072,604.20	1.73
21	601168	西部矿业	6,486,649	68,174,680.99	1.71
22	600362	江西铜业	3,526,019	66,923,840.62	1.68
23	000975	银泰黄金	5,668,760	66,324,492.00	1.66
24	600392	盛和资源	4,770,459	61,395,807.33	1.54
25	600497	驰宏锌锗	12,118,885	60,836,802.70	1.53
26	000831	中国稀土	1,998,700	59,161,520.00	1.48
27	002532	天山铝业	9,494,983	56,874,948.17	1.43
28	600549	厦门钨业	2,892,781	55,049,622.43	1.38
29	000960	锡业股份	3,361,000	52,263,550.00	1.31
30	600711	盛屯矿业	10,682,242	51,915,696.12	1.30
31	002056	横店东磁	2,763,300	50,319,693.00	1.26
32	002203	海亮股份	4,055,502	48,706,579.02	1.22
33	002192	融捷股份	705,919	47,176,566.77	1.18
34	601677	明泰铝业	3,300,415	45,809,760.20	1.15
35	600338	西藏珠峰	2,489,033	45,449,742.58	1.14
36	000878	云南铜业	4,090,800	45,203,340.00	1.13
37	300748	金力永磁	1,455,480	43,547,961.60	1.09
38	000970	中科三环	3,309,825	42,431,956.50	1.06
39	000060	中金岭南	8,901,934	42,284,186.50	1.06
40	000762	西藏矿业	1,416,900	41,982,747.00	1.05
41	600673	东阳光	5,122,502	36,933,239.42	0.93
42	601958	金钼股份	3,294,111	36,729,337.65	0.92
43	002155	湖南黄金	2,859,600	34,887,120.00	0.88
44	600456	宝钛股份	976,882	33,057,686.88	0.83
45	603876	鼎胜新材	1,501,200	28,808,028.00	0.72
46	601212	白银有色	10,073,989	27,401,250.08	0.69
47	603826	坤彩科技	474,813	23,740,650.00	0.60
48	301071	力量钻石	528,869	23,270,236.00	0.58
49	000688	国城矿业	1,143,800	17,351,446.00	0.44
50	301219	腾远钴业	404,690	15,119,218.40	0.38

### 7.3.2 期末积极投资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

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	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
2	688502	茂莱光学	1,509	269,492.31	0.01
3	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
4	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
5	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00

6	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
7	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
8	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
9	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
10	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
11	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
12	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
13	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
14	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
15	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
16	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
17	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
18	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
19	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
20	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
21	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
22	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
23	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
24	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
25	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
26	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
27	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
28	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
29	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
30	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
31	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
32	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
33	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
34	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
35	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
36	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
37	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
38	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
39	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
40	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
41	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
42	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
43	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
44	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
45	601065	江盐集团	802	9,495.68	0.00
46	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
47	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
48	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00

49	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
50	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
51	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
52	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
53	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
54	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
55	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
56	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
57	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
58	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
59	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
60	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
61	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
62	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
63	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
64	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	002466	天齐锂业	239,748,809.54	8.24
2	002460	赣锋锂业	209,707,281.25	7.20
3	002738	中矿资源	100,935,390.78	3.47
4	300390	天华新能	73,908,479.26	2.54
5	000807	云铝股份	73,251,428.97	2.52
6	000933	神火股份	69,690,139.50	2.39
7	002497	雅化集团	66,792,229.97	2.29
8	000831	中国稀土	66,644,552.52	2.29
9	002240	盛新锂能	65,691,701.56	2.26
10	002756	永兴材料	64,681,207.16	2.22
11	000630	铜陵有色	63,682,466.54	2.19
12	002532	天山铝业	56,627,141.96	1.95
13	002192	融捷股份	53,766,173.87	1.85
14	000975	银泰黄金	53,734,845.69	1.85
15	002056	横店东磁	48,747,394.39	1.67
16	000762	西藏矿业	45,070,186.94	1.55
17	002155	湖南黄金	40,315,014.00	1.38
18	000878	云南铜业	38,724,173.76	1.33
19	300748	金力永磁	38,669,670.35	1.33
20	000960	锡业股份	38,246,207.79	1.31

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	002466	天齐锂业	153,076,845.44	5.26
2	002460	赣锋锂业	128,651,429.99	4.42
3	601899	紫金矿业	73,157,363.00	2.51
4	002738	中矿资源	60,089,615.94	2.06
5	000807	云铝股份	46,101,256.70	1.58
6	000831	中国稀土	44,347,701.22	1.52
7	000933	神火股份	44,235,106.84	1.52
8	300390	天华新能	41,753,887.28	1.43
9	002240	盛新锂能	41,692,653.49	1.43
10	002497	雅化集团	40,610,745.11	1.39
11	000630	铜陵有色	40,192,918.00	1.38
12	300618	寒锐钴业	36,421,411.88	1.25
13	002192	融捷股份	33,889,528.67	1.16
14	000975	银泰黄金	33,257,083.00	1.14
15	002056	横店东磁	32,448,977.75	1.11
16	002756	永兴材料	32,443,363.40	1.11
17	000762	西藏矿业	29,228,375.16	1.00
18	002532	天山铝业	28,583,726.60	0.98
19	000960	锡业股份	24,180,165.46	0.83
20	000878	云南铜业	23,910,037.34	0.82

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	1,847,254,106.14
卖出股票收入（成交）总额	1,198,395,014.93

注：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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江西赣锋锂业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会江西监管局的处罚。除上述证券的发行主体外，本

基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金为指数型基金,因复制指数被动持有,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	663,243.11
2	应收清算款	272,120.32
3	应收股利	256,811.99
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	94,394.59
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,286,570.01

### 7.12.4 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债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603799	华友钴业	41,355,728.00	1.04	转融通融出
2	002738	中矿资源	20,905,776.00	0.52	转融通融出
3	002466	天齐锂业	6,592,513.00	0.17	转融通融出
4	601899	紫金矿业	4,665,111.00	0.12	转融通融出
5	600111	北方稀土	2,896,784.00	0.07	转融通融出
6	600489	中金黄金	2,894,466.00	0.07	转融通融出
7	002460	赣锋锂业	2,212,848.00	0.06	转融通融出
8	601600	中国铝业	1,536,651.00	0.04	转融通融出

9	600547	山东黄金	1,451,064.00	0.04	转融通融出
10	603993	洛阳钼业	1,360,216.00	0.03	转融通融出

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301486	致尚科技	277,921.20	0.01	新股未上市
2	688502	茂莱光学	269,492.31	0.01	新股锁定期
3	688249	晶合集成	133,734.30	0.00	新股锁定期
4	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.00	新股未上市
5	301488	豪恩汽电	10,422.36	0.00	新股锁定期
6	688443	智翔金泰	89,443.17	0.00	新股锁定期

## § 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

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		南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
53,578	72,026.56	1,369,180,904.00	35.48%	961,720,628.00	24.92%	1,528,137,468.00	39.60%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华夏基金-中央汇金资产管理有限责任公司-华夏基金-汇金资管单一资产管理计划	122,110,300.00	3.16%
2	中国人寿保险股份有限公司万能账户(国寿资产受托)	103,273,700.00	2.68%
3	中国光大银行股份有限公司-浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)	85,377,800.00	2.21%
4	交通银行股份有限公司-浦银安盛颐 and 稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)	83,154,600.00	2.15%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司-	58,949,400.00	1.53%

	分红-个人分红		
6	国泰君安证券股份有限公司	53,400,000.00	1.38%
7	博时基金-恒大人寿保险有限公司-分红险-博时基金恒博1号管理人中管理人(MOM	41,727,000.00	1.08%
8	平安证券-农业银行-平安证券鸿运天成1号 FOF 集合资产管理计划	40,000,000.00	1.04%
9	兴业银行股份有限公司-浦银安盛兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)	31,445,300.00	0.81%
10	广东粤财信托有限公司-粤财信托·粤银3号单一资金信托计划	30,423,100.00	0.79%
11	中国工商银行股份有限公司-南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金发起	1,528,137,468.00	39.60%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

### 8.4 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情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年8月3日)基金份额总额	447,539,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,737,039,000.00
本报告期基金总申购份额	2,903,500,000.00
减：报告期基金总赎回份额	1,781,500,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,859,039,000.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

## 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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，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，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
兴业证券	1	2,418,869,095.54	79.79%	241,911.57	79.79%	-
海通证券	1	315,833,263.88	10.42%	31,595.65	10.42%	-
中信建投	1	277,981,743.35	9.17%	27,798.38	9.17%	-
华泰证券	2	18,789,829.32	0.62%	1,879.08	0.62%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

退租交易单元：

无

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
兴业证券	1,200.01	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

## 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	关于南方基金管理股份有限公司旗下上交所ETF 申购赎回清单版本更新的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
2	南方基金关于旗下部分基金增加国金证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-20
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-01
4	南方基金关于旗下部分基金增加东海证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-10
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
7	南方基金关于旗下部分基金增加东方财富证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
8	南方基金关于旗下部分基金增加华宝证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-07
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-29
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
12	南方基金关于旗下部分基金增加联储证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
13	南方基金关于旗下部分基金增加华福证券为申购赎回代理券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-30
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资	上海证券报、基金管	2023-06-15

	关联方承销证券的关联交易公告	理人网站、中国证监会基金电子披露网站	
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20230101-20230630	1,371,912,568.00	362,650,600.00	206,425,700.00	1,528,137,468.00	39.60%
产品特有风险							
本基金存在持有基金份额超过 20% 的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。							

注：申购份额包含红利再投资和份额折算。

### 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、中国证监会批准设立南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证申万有色金属交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>