

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金
2021 年中期报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 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	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.9 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	11
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	33
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	33
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权益投资明细	33
7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	33
7.4.2 积极投资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益投资明细	42
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	44
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	44

7.11 投资组合报告附注	45
8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
9 开放式基金份额变动	46
10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	48
11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录	49
11.2 存放地点	49
11.3 查阅方式	49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金
基金简称	中银标普全球资源等权重指数（QDII）
基金主代码	000049
交易代码	000049
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 3 月 19 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	28,086,432.44 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，以低成本、低换手率实现对标普全球精选自然资源等权重指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。本基金控制目标为基金净值收益率与标的指数收益率之间的年化跟踪误差不超过 5%。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标普全球精选自然资源等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标普全球精选自然资源等权重指数成份股及其权重的变化进行相应调整，达到有效跟踪标的指数的目的。但在因特殊情况（如股票停牌、流动性不足）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。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金以及结构性产品，以优化投资组合的构建，达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	人民币计价的标普全球精选自然资源等权重指数（NTR）收益率×95%+人民币活期存款收益率×5%（税后）。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及与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		中银基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳向军	张燕
	联系电话	021-38834999	0755-83199084
	电子邮箱	clientservice@bocim.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38834788 400-888-5566	95555
传真		021-68873488	0755-83195201
注册地址		上海市银城中路200号中银大	深圳市深南大道7088号招商银

	厦45层	行大厦
办公地址	上海市银城中路200号中银大厦10层、11层、26层、45层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	章砚	缪建民

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-
	中文	-
注册地址	-	140 Broadway New York, NY
办公地址	-	140 Broadway New York, NY
邮政编码	-	10005

注：本基金目前不设境外投资顾问。基金管理人有权选择、更换或撤销境外投资顾问，并根据法律法规和《基金合同》的有关规定公告。

2.5 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	http://www.bocim.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼

2.6 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（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	4,258,149.02
本期利润	4,009,217.74
加权平均基金份额本期利润	0.1612
本期加权平均净值利润率	11.61%
本期基金份额净值增长率	16.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	11,778,087.20
期末可供分配基金份额利润	0.4194
期末基金资产净值	39,864,519.64
期末基金份额净值	1.419
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	41.90%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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（为期末余额，不是当期发生数）。

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	-2.47%	1.05%	-2.13%	1.22%	-0.34%	-0.17%
过去三个月	3.20%	1.14%	4.24%	1.29%	-1.04%	-0.15%
过去六个月	16.79%	1.22%	17.57%	1.31%	-0.78%	-0.09%
过去一年	38.57%	1.18%	41.70%	1.24%	-3.13%	-0.06%
过去三年	26.13%	1.43%	38.55%	1.56%	-12.42%	-0.13%
过去五年	62.73%	1.21%	91.46%	1.31%	-28.73%	-0.10%
自基金合同生效 日起	41.90%	1.20%	69.89%	1.31%	-27.99%	-0.11%

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

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金
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
(2013 年 3 月 19 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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

本基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等 142 只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

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		
陈学林	基金经理	2013-03-19	-	22	中银基金管理有限公司助理副总裁（AVP），工商管理硕士。曾任统一期货股份有限公司交易员，凯基证券投资信托股份有限公司基金经理。2010 年加入中银基金管理有限公司，曾担任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理助理。2013 年 3 月至今任中银标普全球资源等权重指数（QDII）基金基金经理，2013 年 7 月至 2020 年 4 月任中银全球策略（QDII-FOF）基金基金经理。具备基金从业资格。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金目前不设境外投资顾问。基金管理人有权选择、更换或撤销境外投资顾问，并根据法律法规和《基金合同》的有关规定公告。

4.3 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》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，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，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生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% 的情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球发达国家疫情总体好转，二季度印度疫情爆发带动东南亚和英国疫情反复，截止 6 月末，美、英、中、印度和巴西全部完成疫苗接种占比分别为 45%、47%、16%、4%、12%。美国消费继续复苏，通胀走高，就业伴随疫苗接种总体恢复，6 月失业率较 2020 年 12 月下降 0.8 个百分点至 5.9%，6 月制造业 PMI 较 2020 年 12 月上行 0.1 个百分点至 60.6，6 月服务业 PMI 较 2020 年 12 月上升 2.4 个百分点至 60.1。美联储维持利率水平和资产购买规模不变，上调 IOER 和 ONRRP 利率，下半年就业恢复后美联储可能明确 QE taper 信号。欧元区继续复苏，6 月失业率较 2020 年末回落 0.4 个百分点至 7.7%，6 月制造业 PMI 较 2020 年末上升 8.2 个百分点至 63.4，6 月服务业 PMI 较 2020 年末上升 11.9 个百分点至 58.3，欧央行 6 月议息会议上提出加快 PEPP 购买步伐。日本央行维持基准利率不变，经济恢复速度放缓，通缩问题有所好转，6 月 CPI 同比较 2020 年末回

升 1.4 个百分点至 0.2%，6 月制造业 PMI 较 2020 年末上行 2.4 个百分点至 52.4。综合来看，全球经济下半年复苏进度边际放缓，主要经济体央行货币政策有边际收紧压力，但货币政策退出宽松力度预计总体较为温和。

国内经济方面，生产数据快速修复后有所转弱，经济结构性分化持续，出口维持高位，地产投资高位回落，而制造业和消费继续缓慢恢复，经济下行压力逐步体现，通胀预期回落。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 持续位于荣枯线上方窄幅震荡，6 月值较 2020 年末走低 1 个百分点至 50.9，同步指标工业增加值 1-6 月累计同比增长 15.9%，较 2020 年末上升 13.1 个百分点。从经济增长动力来看，出口总体偏强，消费投资继续改善：1-6 月美元计价累计出口增速较 2020 年末回升 35 个百分点至 38.6%左右，6 月社会消费品零售总额增速较 2020 年末回升 7.5 个百分点至 12.1%，制造业、房地产、基建投资均缓慢改善，1-6 月固定资产投资增速较 2020 年末回升 9.7 个百分点至 12.6%的水平。通胀方面，CPI 震荡上行，6 月同比增速从 2020 年末的 0.2% 上升 0.9 个百分点至 1.1%，PPI 快速上行后高位震荡，6 月同比增速从 2020 年末的 -0.4% 上升 9.2 个百分点至 8.8%。

2. 市场回顾

今年初始，大宗商品市场便在疫苗加速接种、经济逐渐复苏中的宏观背景之下，保持去年牛市的势头上涨，原油、贵金属、基础金属、农产品等都有不小的涨幅。但是 5 月中之后除了面临涨多获利了结的压力之外，由于疫苗似乎无法有效抑制 Delta 病毒的扩散，加上经历了去年财政大幅刺激之后，整体需求面临回落，因此大宗商品行情从 6 月就开始掉头下跌。其中贵金属因为市场预期 Fed 将进行 Taper，流动性减少，利率将会抬升的影响，所以下跌幅度较大，不仅抹去上半年的涨幅而且到了上半年为止，整体板块的回报率呈现负值的情况。

3. 运行分析

我们继续严格遵守指数投资管理本指数基金。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 16.79%，同期业绩比较基准收益率为 17.57%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，由于中国经济依旧疲软乏力，短期间对于基础金属的需求依然不振，基础金属的价格在三季度应该还是属于区间震荡的行情，但是因为各国都已经宣示将在 2030 年前逐步汰换油车，改换成新能源汽车，加上充电储能设备的需求将会逐渐释放增加，因此我们对于基础金属股票的后市依然看好。贵金属部分因为 Fed 怎么正式表述 Taper 以及将会如何进行 Taper 对于贵金属短期的影响甚剧，而美元指数也会因为市场预期 Fed 将领先于欧央行、日本央行收缩流动性而维持相对强势，

此一因素对于贵金属的行情也有打压的作用，在三季度贵金属预期仍是相对较弱。原油在 OPEC+增产之后，依旧维持 80~70 美元高档震荡，但是因为怀疑疫苗对于 Delta 的保护力以及各国财政纾困带来的效益的减少，市场开始怀疑原油新增需求无以为继，因此能源股在 6 月下跌，我们认为能源股在三季度还是会受到 Delta 疫情的影响，除非新的数据能够证明现有疫苗能够有效阻止 Delta 的扩散以及降低重症与死亡，要不然短期内仍是属于偏弱的行情。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运营部及投资相关部门的相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、基金托管人的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.7.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.7.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。

本基金本报告期末可供分配收益 11,778,087.20 元。本基金本报告期末进行利润分配。

4.9 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

截至本报告期末，本基金已连续超过 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，相

应解决方案已报送中国证监会。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,898,755.50	2,038,922.25
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	36,419,414.02	21,773,179.47
其中：股票投资		36,419,414.02	21,773,179.47
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		460,266.88	-
应收利息	6.4.7.5	477.45	251.00

应收股利		165,919.97	50,414.02
应收申购款		213,028.28	144,916.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	24,001.30	10,876.99
资产总计		43,181,863.40	24,018,559.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		42,978.40	10,503.83
应付赎回款		3,141,885.66	997,892.27
应付管理人报酬		39,170.86	21,310.25
应付托管费		10,682.93	5,811.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,625.91	221,760.88
负债合计		3,317,343.76	1,257,279.11
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	28,086,432.44	18,730,045.56
未分配利润	6.4.7.10	11,778,087.20	4,031,235.09
所有者权益合计		39,864,519.64	22,761,280.65
负债和所有者权益总计		43,181,863.40	24,018,559.76

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.419 元，基金份额总额 28,086,432.44 份。

6.2 利润表

会计主体：中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,441,006.45	4,136,921.60
1.利息收入		6,015.93	6,413.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,015.93	6,413.75
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,682,900.27	2,031,782.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,138,749.92	1,653,825.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	3,945.84	-
股利收益	6.4.7.15	540,204.51	377,956.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-248,931.28	2,096,185.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-58,172.07	-57,875.59
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	59,193.60	60,415.25
减：二、费用		431,788.71	409,568.50
1. 管理人报酬		187,788.09	134,937.47
2. 托管费	6.4.10.2	51,214.97	36,801.10
3. 销售服务费	6.4.10.2	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	40,233.81	52,652.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		14.21	-
7. 其他费用	6.4.7.19	152,537.63	185,177.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,009,217.74	3,727,353.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,009,217.74	3,727,353.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	18,730,045.56	4,031,235.09	22,761,280.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,009,217.74	4,009,217.74
三、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）	9,356,386.88	3,737,634.37	13,094,021.25

其中：1.基金申购款	35,533,688.66	14,265,280.32	49,798,968.98
2.基金赎回款	-26,177,301.78	-10,527,645.95	-36,704,947.73
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	28,086,432.44	11,778,087.20	39,864,519.64
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,735,822.67	1,633,677.05	11,369,499.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,727,353.10	3,727,353.10
三、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）	29,166,626.27	-4,443,632.43	24,722,993.84
其中：1.基金申购款	70,286,116.25	-5,954,153.52	64,331,962.73
2.基金赎回款	-41,119,489.98	1,510,521.09	-39,608,968.89
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	38,902,448.94	917,397.72	39,819,846.66

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：李道滨，主管会计工作负责人：张家文，会计机构负责人：乐妮

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1743 号文《关于核准中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开发行业募集，基金合同于 2013 年 3 月 19 日正式生效，首次设立募集规模为 274,055,778.75 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为中银基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司，基金境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

本基金主要投资于标普全球精选自然资源等权重指数成份股（包括股票和/或存托凭证，下同）、备选成份股，与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会

许可投资的结构性产品及金融衍生产品等，固定收益类证券、银行存款、现金等货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的业绩比较基准为：人民币计价的标普全球精选自然资源等权重指数（NTR）收益率 $\times 95\%$ + 人民币活期存款收益率 $\times 5\%$ （税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	5,898,755.50
定期存款	-
其他存款	-
合计	5,898,755.50

注：于 2021 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 13,181.47 元(折合人民币 85,153.62 元)，加拿大元活期存款 103.12 元(折合人民币 537.22 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		32,960,627.45	36,419,414.02	3,458,786.57
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		32,960,627.45	36,419,414.02	3,458,786.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	477.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.24
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	477.45

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	537.09
待摊费用	23,464.21
合计	24,001.30

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,567.10
应付证券出借违约金	-
应付在途资金	537.22
应付审计费	14,876.39
应付指数使用费	55,645.20
合计	82,625.91

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,730,045.56	18,730,045.56
本期申购	35,533,688.66	35,533,688.66
本期赎回（以“-”号填列）	-26,177,301.78	-26,177,301.78
本期末	28,086,432.44	28,086,432.44

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	6,237,643.40	-2,206,408.31	4,031,235.09
本期利润	4,258,149.02	-248,931.28	4,009,217.74
本期基金份额交易产生的变动数	3,695,492.16	42,142.21	3,737,634.37
其中：基金申购款	14,962,415.68	-697,135.36	14,265,280.32
基金赎回款	-11,266,923.52	739,277.57	-10,527,645.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,191,284.58	-2,413,197.38	11,778,087.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

活期存款利息收入	5,997.45
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	-
其他	18.48
合计	6,015.93

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	23,645,448.87
减：卖出股票成本总额	19,506,698.95
买卖股票差价收入	4,138,749.92

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出权证成交总额	5,149,053.63
减：卖出权证成本总额	4,291,446.03
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	118.38
买卖权证差价收入	857,489.22

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	540,204.51
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	540,204.51

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-248,931.28
——股票投资	-248,931.28
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-248,931.28

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	59,193.60
合计	59,193.60

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	40,233.81
银行间市场交易费用	-
合计	40,233.81

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,401.67
指数使用费	100,153.68
其他	2,347.87
指数许可费	33,758.02
合计	152,537.63

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中银基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行（“哈里曼银行”）	基金境外托管人

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	187,788.09	134,937.47
其中：支付销售机构的客户维护费	73,701.45	52,018.59

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年6月 30日	2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	51,214.97	36,801.10

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.30%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
招商银行股份有限公司	5,813,070.22	5,997.45	4,646,513.04	6,386.69
布朗兄弟哈里曼银行	85,685.28	-	1,000,748.40	-

注：本基金的银行存款分别由基金托管人招商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中面临的的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相对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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多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。

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。

6.4.13.2 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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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，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。

于 2021 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资(2020 年 12 月 31 日:同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日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。

6.4.13.3.1 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》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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，因此除附注 6.4.12 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。此外，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。

于 2021 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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。

本基金的生息资产主要为银行存款及部分应收申购款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产								
银行存款	-	-	-	5,898,755. 50	-	-	-	5,898,755. 50
交易性金 融资产	-	-	-	-	-	-	36,419,41 4.02	36,419,41 4.02

应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	460,266.88	460,266.88
应收股利	-	-	-	-	-	-	165,919.97	165,919.97
应收利息	-	-	-	-	-	-	477.45	477.45
应收申购款	-	-	-	829.82	-	-	212,198.46	213,028.28
其他资产	-	-	-	-	-	-	23,464.21	23,464.21
其他应收款	-	-	-	-	-	-	537.09	537.09
资产总计	-	-	-	5,899,585.32	-	-	37,282,278.08	43,181,863.40
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	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	42,978.40	42,978.40
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	3,141,885.66	3,141,885.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	39,170.86	39,170.86
应付托管费	-	-	-	-	-	-	10,682.93	10,682.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	82,625.91	82,625.91
负债总计	-	-	-	-	-	-	3,317,343.	3,317,343.

							76	76
利率敏感 度缺口	-	-	-	5,899,585. 32	-	-	33,964,93 4.32	39,864,51 9.64
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产								
银行存款	-	-	-	2,038,922. 25	-	-	-	2,038,922. 25
交易性金 融资产	-	-	-	-	-	-	21,773,17 9.47	21,773,17 9.47
应收股利	-	-	-	-	-	-	50,414.02	50,414.02
应收利息	-	-	-	-	-	-	251.00	251.00
应收申购 款	-	-	-	10.00	-	-	144,906.0 3	144,916.0 3
其他应收 款	-	-	-	-	-	-	10,876.99	10,876.99
资产总计	-	-	-	2,038,932. 25	-	-	21,979,62 7.51	24,018,55 9.76
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	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券 清算款	-	-	-	-	-	-	10,503.83	10,503.83
应付赎回 款	-	-	-	-	-	-	997,892.2 7	997,892.2 7
应付管理 人报酬	-	-	-	-	-	-	21,310.25	21,310.25
应付托管 费	-	-	-	-	-	-	5,811.88	5,811.88
应付销售 服务费	-	-	-	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	221,760.88	221,760.88
负债总计	-	-	-	-	-	-	1,257,279.11	1,257,279.11
利率敏感度缺口	-	-	-	2,038,932.25	-	-	20,722,348.40	22,761,280.65

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例低于 10%（2020 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	85,153.62	-	537.22	85,690.84
交易性金融资产	20,880,049.45	1,405,058.61	14,134,305.96	36,419,414.02
应收证券清算	294,579.52	-	165,687.36	460,266.88

款				
应收股利	50,427.54	102,675.78	12,816.65	165,919.97
其他应收款	537.09	-	-	537.09
资产合计	21,310,747.22	1,507,734.39	14,313,347.19	37,131,828.80
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	42,978.40	-	42,978.40
其他负债	-	-	537.22	537.22
负债合计	-	42,978.40	537.22	43,515.62
资产负债表外汇风险敞口净额	21,310,747.22	1,464,755.99	14,312,809.97	37,088,313.18
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	26,286.54	-	2,924.62	29,211.16
交易性金融资产	12,245,571.60	974,812.69	8,552,795.18	21,773,179.47
应收股利	37,731.41	4,647.54	8,035.07	50,414.02
其他应收款	373.16	10,503.83	-	10,876.99
资产合计	12,309,962.71	989,964.06	8,563,754.87	21,863,681.64
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	10,503.83	-	10,503.83
其他负债	10,503.98	-	373.17	10,877.15
负债合计	10,503.98	10,503.83	373.17	21,380.98
资产负债表外汇风险敞口净额	12,299,458.73	979,460.23	8,563,381.70	21,842,300.66

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	港币相对人民币升值 5%	-	增加约 5
	港币相对人民币贬值 5%	-	减少约 5

	美元相对人民币升值 5%	-	增加约 61
	美元相对人民币贬值 5%	-	减少约 61
	其他币种相对人民币升值 5%	-	增加约 43
	其他币种相对人民币贬值 5%	-	减少约 43

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于境外公募基金及证券市场公开发行和挂牌交易的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金投资于标普全球精选自然资源等权重指数成份股、备选成份股以及与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会许可投资的结构性产品及金融衍生产品的比例为基金资产的 80%~95%，其中投资于与标普全球精选自然资源等权重指数相关的公募基金、上市交易型基金、中国证监会许可投资的结构性产品及金融衍生产品的比例不超过基金资产的 10%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例为基金资产的 5%~20%，其中投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。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，通过特定指标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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	36,419,414.02	91.36	21,773,179.47	95.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	36,419,414.02	91.36	21,773,179.47	95.66

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 8	增加约 101
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 8	减少约 101

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	36,419,414.02	84.34
	其中：普通股	27,625,018.97	63.97
	存托凭证	8,794,395.05	20.37
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融	-	-

	资产		
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,898,755.50	13.66
8	其他各项资产	863,693.88	2.00
9	合计	43,181,863.40	100.00

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	16,615,375.02	41.68
英国	7,796,306.92	19.56
加拿大	6,272,269.55	15.73
澳大利亚	4,330,403.92	10.86
香港	1,405,058.61	3.52
合计	36,419,414.02	91.36

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，此处股票包括普通股和优先股。

2、ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

3、由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
非必须消费品	337,231.69	0.85
必须消费品	2,453,869.33	6.16
能源	10,138,571.25	25.43
金融	417,887.66	1.05
材料	22,014,840.63	55.22
房地产	1,057,013.46	2.65
合计	36,419,414.02	91.36

注：1、由管理人与托管人协商确认，采用国际通用的具有权威性的行业分类标准。

2、由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

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权益投资明细

7.4.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
1	WHITEH AVEN COAL LTD	Whitehaven Coal 有限公司	WHC AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	52,993	498,898.99	1.25
2	PETROL EO BRASILE IRO S.A.-ADR	巴西石油 公司	PBR US	纽约证 券交易 所	美国	6,173	487,710.35	1.22
3	OCCIDE NTAL PETROL EUM CORP	西方石油	OXY US	纽约证 券交易 所	美国	2,348	474,313.20	1.19
4	LUKOIL OAO-SP ON ADR	卢克石油 公司	LKOD LI	英国伦 敦国际 证券交 易所	英国	751	449,349.18	1.13
5	ECOPET ROL SA-SPON SORED ADR	哥伦比亚 国家石油 公司	EC US	纽约证 券交易 所	美国	4,702	444,088.20	1.11
6	NOVATE K OAO-SP ONS GDR REG S	诺瓦泰克 公司	NVTK LI	英国伦 敦国际 证券交 易所	英国	313	443,427.08	1.11
7	QUIMIC AY MINERA CHIL-SP ADR	智利化工 矿业公司	SQM US	纽约证 券交易 所	美国	1,414	432,339.74	1.08
8	TATNEFT PAO-SPO NSORED ADR	鞑靼石油 公司	ATAD LI	英国伦 敦国际 证券交 易所	英国	1,487	419,021.08	1.05
9	ROSNEF T OJSC-RE G S GDR	俄罗斯石 油公司	ROSN LI	英国伦 敦国际 证券交 易所	英国	8,371	418,559.83	1.05

10	WASHINGTON H. SOUL PATTERNS	Washington H Soul Pattinson	SOL AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	2,553	417,887.66	1.05
11	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业	1171 HK	香港联合交易所	香港	48,000	416,971.93	1.05
12	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽约证券交易所	美国	1,058	416,238.46	1.04
13	CANADIAN NATURAL RESOURCES	加拿大自然资源有限公司	CNQ CN	多伦多证券交易所	加拿大	1,765	413,780.42	1.04
14	GAZPROM OAO-SPON ADR	俄罗斯天然气工业公司	OGZD LI	英国伦敦国际证券交易所	英国	8,369	412,080.22	1.03
15	VALE SA-SP ADR	淡水河谷公司	VALE US	纽约证券交易所	美国	2,781	409,793.92	1.03
16	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Pioneer 自然资源公司	PXD US	纽约证券交易所	美国	389	408,409.33	1.02
17	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	XOM US	纽约证券交易所	美国	996	405,873.10	1.02
18	RELIANCE INDUS-SPONS GDR 144A	印度瑞来斯实业公司	RIGD LI	英国伦敦国际证券交易所	英国	1,076	393,430.43	0.99
19	SUNCOR ENERGY INC	森科能源公司	SU CN	多伦多证券交易所	加拿大	2,543	393,341.05	0.99
20	EOG RESOURCES INC	EOG 资源	EOG US	纽约证券交易所	美国	728	392,414.38	0.98

21	DARLING INTERNATIONAL INC	Darling Ingredients 公司	DAR US	纽约证 券交易 所	美国	893	389,398.68	0.98
22	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	PhosAgro 公开合股 公司	PHOR LI	英国伦 敦国际 证券交 易所	英国	2,957	386,634.92	0.97
23	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家 壳牌	RDSA LN	英国伦 敦证券 交易所	英国	2,984	386,005.41	0.97
24	VALERO ENERGY CORP	Valero 能 源	VLO US	纽约证 券交易 所	美国	761	383,851.91	0.96
25	NUTRIE N LTD	Natrien 有 限公司	NTR CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	980	383,474.56	0.96
26	MARATHON PETROLEUM CORP	马拉松石 油公司	MPC US	纽约证 券交易 所	美国	982	383,293.50	0.96
27	DOMTAR CORP	Domtar 公 司	UFS US	纽约证 券交易 所	美国	1,079	383,095.82	0.96
28	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX US	纽约证 券交易 所	美国	566	382,973.07	0.96
29	PHILLIPS 66	Phillips 66	PSX US	纽约证 券交易 所	美国	689	381,985.58	0.96
30	TECK RESOURCES LTD-CLSB	加拿大泰 克资源有 限公司	TECK/B CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	2,566	381,658.98	0.96
31	CORTEVA INC	Corteva Inc	CTVA US	纽约证 券交易 所	美国	1,328	380,479.22	0.95
32	CHINA SHENHUA	中国神华	1088 HK	香港联 合交易 所	香港	30,000	379,927.73	0.95

	ENERGY CO-H							
33	ARCELO RMITTA L-NY REGISTE RED	安赛乐米 塔尔	MT US	纽约证 券交易 所	美国	1,883	377,825.28	0.95
34	EQUINO R ASA-SPO N ADR	挪威国家 石油公司	EQNR US	纽约证 券交易 所	美国	2,749	376,486.88	0.94
35	FIRST QUANTU M MINERA LS LTD	第一量子 矿业有限 公司	FM CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	2,521	375,228.49	0.94
36	BP PLC	BP 公司	BP/ LN	英国伦 敦证券 交易所	英国	13,315	375,005.66	0.94
37	CF INDUST RIES HOLDIN GS INC	CF 工业控 股股份有 限公司	CF US	纽约证 券交易 所	美国	1,125	373,918.66	0.94
38	SOUTH3 2 LTD	南拓 32 有 限公司	S32 AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	26,069	370,667.39	0.93
39	ENI SPA-SPO NSORED ADR	埃尼集团	E US	纽约证 券交易 所	美国	2,348	369,955.20	0.93
40	CAMECO CORP	Cameco 公 司	CCO CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	2,980	368,871.77	0.93
41	GLENCO RE XSTRAT A PLC	嘉能可	GLEN LN	英国伦 敦证券 交易所	英国	13,255	366,738.36	0.92
42	ELDERS LTD	艾德士有 限公司	ELD AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	6,539	366,509.90	0.92
43	FORTES CUE METALS GROUP	FMG 集团	FMG AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	3,234	366,296.91	0.92

44	MONDI PLC	盟迪公共 有限公司	MNDI LN	英国伦 敦证券 交易所	英国	2,148	365,092.14	0.92
45	RIO TINTO PLC	力拓公司	RIO LN	英国伦 敦证券 交易所	英国	686	364,883.46	0.92
46	FRANCO -NEVAD A CORP	Franco-Nev ada 公司	FNV CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	388	363,623.10	0.91
47	WOODSI DE PETROL EUM L	伍德赛德 石油有限 公司	WPL AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	3,373	363,544.26	0.91
48	TOTAL SA-SPON ADR	道达尔集 团	TTE US	纽约证 券交易 所	美国	1,243	363,433.47	0.91
49	RAYONI ER INC	瑞安公司	RYN US	纽约证 券交易 所	美国	1,562	362,558.00	0.91
50	BHP BILLITO N LTD	必和必拓 集团	BHP AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利亚	1,538	362,507.36	0.91
51	INGREDI ON INC	宜瑞安公 司	INGR US	纽约证 券交易 所	美国	617	360,722.29	0.90
52	POSCO- ADR	浦项制铁 公司	PKX US	纽约证 券交易 所	美国	727	360,549.74	0.90
53	FRESH DEL MONTE PRODUC E INC	新鲜德尔 蒙农产品 公司	FDP US	纽约证 券交易 所	美国	1,695	360,031.71	0.90
54	NUCOR CORP	纽柯公司	NUE US	纽约证 券交易 所	美国	580	359,436.09	0.90
55	WEST FRASER TIMBER CO LTD	West Fraser 木材有限 公司	WFG CN	多伦多 证券交 易所	加拿大	771	357,444.24	0.90
56	VEDANT A LTD-AD R	韦丹塔有 限公司	VEDL US	纽约证 券交易 所	美国	3,872	355,191.80	0.89
57	FMC	FMC 公司	FMC US	纽约证	美国	504	352,287.34	0.88

	CORP			券交易 所				
58	NEENAH PAPER INC	威斯康辛 纸业公司	NP US	纽约证 券交易 所	美国	1,084	351,327.89	0.88
59	WEYER HAEUSE R CO	惠好	WY US	纽约证 券交易 所	美国	1,579	351,101.14	0.88
60	WHEATO N PRECIO US METALS CORP	Wheaton 贵 金属公司	WPM CN	多伦多 证交易 所	加拿大	1,233	350,983.32	0.88
61	CANFOR CORP	加福林业 公司	CFP CN	多伦多 证交易 所	加拿大	2,374	350,751.60	0.88
62	MMC NORILS K NICKEL JSC-ADR	诺里尔斯 克镍业公 司	MNOD LI	英国伦 敦国际 证交易 所	英国	1,590	349,952.02	0.88
63	ANTOFA GASTA PLC	Antofagast a 公司	ANTO LN	英国伦 敦证交 易所	英国	2,714	348,336.62	0.87
64	ARCHER -DANIEL S-MIDLA ND CO	Archer-Dan iels-Midlan d 公司	ADM US	纽约证 券交易 所	美国	886	346,853.11	0.87
65	STELLA- JONES INC	Stella-Jone s 股份有 限公司	SJ CN	多伦多 证交易 所	加拿大	1,491	346,670.79	0.87
66	BUNGE LTD	邦吉有限 公司	BG US	纽约证 券交易 所	美国	686	346,331.78	0.87
67	LOUISIA NA-PACI FIC CORP	路易斯安 娜太平洋	LPX US	纽约证 券交易 所	美国	888	345,857.73	0.87
68	MOSAIC CO/THE	Mosaic 公 司	MOS US	纽约证 券交易 所	美国	1,677	345,699.78	0.87
69	POTLAT CH CORP	PotlatchDel tic 公司	PCH US	纽约证 券交易 所	美国	1,000	343,354.32	0.86

70	SOUTHERN COPPER CORP	南方铜业公司	SCCO US	纽约证券交易所	美国	826	343,214.26	0.86
71	ROYAL GOLD INC	皇家黄金股份有限公司	RGLD US	纽约证券交易所	美国	465	342,750.30	0.86
72	FREEMET-MCM ORAN COPPER	自由港迈克墨伦股份有限公司	FCX US	纽约证券交易所	美国	1,422	340,902.19	0.86
73	SIBANYE-STILLWATER LTD-ADR	Sibanye Stillwater Ltd	SBSW US	纽约证券交易所	美国	3,148	340,227.89	0.85
74	POLYUS PJSC-REG S-GDR	Polyus 公开合股公司	PLZL LI	英国伦敦国际证券交易所	英国	544	340,007.98	0.85
75	SCHWEITZER-MAUDUIT INTL INC	Schweitzer-Mauduit 国际公司	SWM US	纽约证券交易所	美国	1,295	337,812.20	0.85
76	SCOTTS MIRACLEGRO CO-CL A	Scotts Miracle-Gro 公司	SMG US	纽约证券交易所	美国	272	337,231.69	0.85
77	BOISE CASCADE CO	Boise Cascade 公司	BCC US	纽约证券交易所	美国	893	336,613.52	0.84
78	ANGLO AMERICAN PLC	英美公司	AAL LN	英国伦敦证券交易所	英国	1,310	336,447.59	0.84
79	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	Polymetal 国际公共有限公司	POLY LN	英国伦敦证券交易所	英国	2,411	335,099.74	0.84
80	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	柯克兰莱克黄金股份有限公司	KL CN	多伦多证券交易所	加拿大	1,339	333,233.41	0.84
81	NEWCRE	纽克雷斯	NCM AU	澳大利	澳大利亚	2,697	330,864.68	0.83

	ST MINING LTD	特矿业有限公司		亚证券交易所				
82	NUFARM LTD	澳大利亚 Nufarm 有限公司	NUF AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	14,881	330,742.49	0.83
83	SEVERSTAL - GDR REG S	谢韦尔钢铁公司	SVST LI	英国伦敦国际证券交易所	英国	2,378	330,285.53	0.83
84	EVRAZ PLC	Evraz 公共有限公司	EVR LN	英国伦敦证券交易所	英国	6,185	327,376.50	0.82
85	NEWMONT MINING CORP	纽蒙黄金公司	NEM US	纽约证券交易所	美国	794	325,096.26	0.82
86	FRESNILLO PLC	弗雷斯尼洛公共有限公司	FRES LN	英国伦敦证券交易所	英国	4,701	324,316.18	0.81
87	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	Northern Star 资源有限公司	NST AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	6,801	322,778.07	0.81
88	NOVOLIS PET STEEL-GDR REG S	新利佩茨克钢铁公司	NLMK LI	英国伦敦国际证券交易所	英国	1,582	321,926.16	0.81
89	PAN AMERICAN SILVER CORP	泛美白银公司	PAAS CN	多伦多证券交易所	加拿大	1,737	320,343.41	0.80
90	BARRICK GOLD CORP	巴里克黄金公司	ABX CN	多伦多证券交易所	加拿大	2,365	315,908.91	0.79
91	EVOLUTION MINING LTD	Evolution 矿业有限公司	EVN AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	14,456	315,684.35	0.79
92	AGNICO EAGLE MINES LTD	阿哥尼可老鹰矿场有限公司	AEM CN	多伦多证券交易所	加拿大	797	311,243.73	0.78

93	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	理文造纸	2314 HK	香港联合交易所	香港	63,000	309,808.35	0.78
94	YAMANA GOLD INC	亚马纳黄金股份有限公司	YRI CN	多伦多证券交易所	加拿大	11,278	306,701.08	0.77
95	B2GOLD CORP	B2Gold 公司	BTO CN	多伦多证券交易所	加拿大	11,171	302,627.31	0.76
96	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	玖龙纸业	2689 HK	香港联合交易所	香港	36,000	298,350.60	0.75
97	KINROSS GOLD CORP	金罗斯黄金公司	K CN	多伦多证券交易所	加拿大	7,238	296,383.38	0.74
98	COSTA GROUP HOLDINGS LTD	Costa 集团控股有限公司	CGC AU	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	17,682	284,021.86	0.71
99	GOLD FIELDS LTD-SPOONS ADR	金田有限公司	GFI US	纽约证券交易所	美国	4,822	277,240.36	0.70
100	ANGLOGOLD ASHANTI-SPONS ADR	AngloGold Ashanti 有限公司	AU US	纽约证券交易所	美国	2,292	275,105.68	0.69
101	THUNGELA RESOURCES LTD	Thungela Resources Ltd	TGA LN	英国伦敦证券交易所	英国	131	2,330.83	0.01

7.4.2 积极投资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益投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

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名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	WOODSIDE PETROLEUM L	WPL AU	548,797.75	2.41
2	CANFOR CORP	CFP CN	506,412.09	2.22
3	COSTA GROUP HOLDINGS LTD	CGC AU	486,231.70	2.14
4	YANZHOU COAL MINING CO-H	1171 HK	447,227.88	1.96
5	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	NST AU	440,040.56	1.93
6	WHITEHAVEN COAL LTD	WHC AU	436,996.08	1.92
7	EVOLUTION MINING LTD	EVN AU	430,587.84	1.89
8	NUCOR CORP	NUE US	428,782.42	1.88
9	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	SQM US	409,618.16	1.80
10	NEWCREST MINING LTD	NCM AU	407,789.23	1.79
11	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	ATAD LI	398,959.53	1.75
12	FRESNILLO PLC	FRES LN	396,062.36	1.74
13	ELDERS LTD	ELD AU	393,018.92	1.73
14	FRANCO-NEVADA CORP	FNV CN	385,510.07	1.69
15	ANTOFAGASTA PLC	ANTO LN	382,261.68	1.68
16	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	SOL AU	374,979.30	1.65
17	FRESH DEL MONTE PRODUCE INC	FDP US	374,523.15	1.65
18	BOISE CASCADE CO	BCC US	373,920.08	1.64
19	DARLING INTERNATIONAL INC	DAR US	368,088.04	1.62
20	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	367,498.04	1.61

注：“买入金额”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名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	----------	------	----------	----------------

1	NUCOR CORP	NUE US	516,888.71	2.27
2	VEDANTA LTD-ADR	VEDL US	443,135.40	1.95
3	DOMTAR CORP	UFS US	398,380.78	1.75
4	YANZHOU COAL MINING CO-H	1171 HK	396,069.05	1.74
5	WEST FRASER TIMBER CO LTD	WFG CN	391,914.49	1.72
6	LOUISIANA-PACIFIC CORP	LPX US	352,164.13	1.55
7	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	349,568.15	1.54
8	ARCELORMITTAL-NY REGISTERED	MT US	341,943.13	1.50
9	FREEPORT-MCMORAN COPPER	FCX US	316,058.86	1.39
10	CAMECO CORP	CCO CN	311,953.17	1.37
11	EOG RESOURCES INC	EOG US	309,909.58	1.36
12	EVRAZ PLC	EVR LN	309,712.36	1.36
13	COSTA GROUP HOLDINGS LTD	CGC AU	309,125.91	1.36
14	FRESH DEL MONTE PRODUCE INC	FDP US	299,945.11	1.32
15	SEVERSTAL - GDR REG S	SVST LI	298,958.92	1.31
16	EVOLUTION MINING LTD	EVN AU	293,998.18	1.29
17	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	FM CN	290,392.02	1.28
18	BOISE CASCADE CO	BCC US	285,456.51	1.25
19	GOLD FIELDS LTD-SPONS ADR	GFI US	279,575.36	1.23
20	ANTOFAGASTA PLC	ANTO LN	276,560.34	1.22

注：“卖出金额”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 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	34,401,864.78
卖出收入（成交）总额	23,645,448.87

注：“买入成本”、“卖出收入”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 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	460,266.88
3	应收股利	165,919.97
4	应收利息	477.45
5	应收申购款	213,028.28
6	其他应收款	537.09
7	待摊费用	23,464.21
8	其他	-
9	合计	863,693.88

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资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。

7.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

由于计算中四舍五入的原因，本报告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

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
4,913	5,716.76	554,424.89	1.9740%	27,532,007.55	98.0260%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	7.01	0.0000%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 3 月 19 日）基金份额总额	274,055,778.75
本报告期期初基金份额总额	18,730,045.56
本报告期基金总申购份额	35,533,688.66
减：本报告期基金总赎回份额	26,177,301.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	28,086,432.44

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转出份额。

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，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

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内没有改聘会计师事务所。

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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到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	
Morgan Stanley	-	40,895,911.56	70.45%	16,848.58	73.72%	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	-	17,151,401.91	29.55%	6,006.68	26.28%	-

注：1、本公司从事境外投资业务时，将需要委托境外券商代理或协助进行交易操作。公司作为基金管理人将勤勉尽责地承担受信责任，挑选、委托合适的境外券商以取得有益于基金持有人利益的最佳执行；

2、根据相关法规与基金管理人的制度，基金管理人 QDII 业务团队按照以下标准，对 QDII 投资交易单元进行选择：（一）交易执行能力。主要指境外券商是否对交易指令进行了有效的执行以及能否取得较高质量的成交结果。衡量交易执行能力的指标主要有：下单及成交回报的准确性和及时性、券款划拨的准确性和及时性、交易保密能力等；（二）研究团队的实力和水平。衡量境外券商的研究能力的指标主要有：宏观经济研究、行业研究、市场走向分析、专题研究报告的水平，以及推荐投资工具的有效性等；（三）服务水平。主要指是否与基金管理人有较强的长期合作意愿并积极提供个性化服务；（四）交易成本。主要指费用是否总体可控，交易佣金相较于交易执行水平以及投研支持服务而言是否合理、优惠。符合上述条件的境外券商是 QDII 业务团队考虑长期合作的对象，可成为备选券商，经 QDII 投资决策委员会审核批准，由交易室相关人员与其开设证券账户。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无变更。

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
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs And Co. LLC.	-	-	-	-	4,064.22	100.00%	-	-

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	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-01-21
2	中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构及参加	中国证监会规定媒介	2021-03-04
3	中银基金管理有限公司关于开展电子直销平台费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-17
4	中银标普全球自然资源等权重指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2021-03-29
5	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定媒介	2021-03-29
6	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2021-03-29
7	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2021-03-29
8	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定媒介	2021-03-30
9	中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2021-04-21
10	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-22
11	中银基金管理有限公司关于调整电子直销平台中国银行借记卡定期定额申购费率的公告	中国证监会规定媒介	2021-04-29
12	中银基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-13
13	中银基金管理有限公司关于新增鼎信汇金(北京)投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-21
14	关于中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金恢复大额申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-22
15	中银基金管理有限公司关于新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通定期定额投资及转换业务及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2021-05-28

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人互联网站。

11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日