

国泰国证有色金属行业指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人决定自 2023 年 7 月 24 日起，调低本基金的托管费率并对基金合同有关条款进行修订。具体可查阅本基金管理人于 2023 年 7 月 22 日发布的《国泰基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

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	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 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 中期财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	62
7.1 期末基金资产组合情况.....	62
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	63
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.....	64
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	68
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.....	68
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.....	68
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.....	69
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.....	69
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69
7.11 投资组合报告附注.....	69
8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	71

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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的情况.....	72
9 开放式基金份额变动.....	73
10 重大事件揭示.....	73
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11 备查文件目录.....	75
11.1 备查文件目录.....	75
11.2 存放地点.....	75
11.3 查阅方式.....	75

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰国证有色金属行业指数证券投资基金	
基金简称	国泰国证有色金属行业指数	
场内简称	有色金属 LOF	
基金主代码	160221	
交易代码	160221	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,366,785,791.51 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2021 年 1 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	国泰国证有色金属行业指数 A	国泰国证有色金属行业指数 C
下属分级基金的交易代码	160221	015596
报告期末下属分级基金的份额总额	1,332,566,138.96 份	34,219,652.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略。
业绩比较基准	国证有色金属行业指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		国泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	王小飞
	联系电话	021-31081600转	021-60637103
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	(021) 31089000, 400-888-8688	021-60637228
传真	021-31081800	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200082	100033
法定代表人	邱军	田国立

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	http://www.gtfund.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层和本基金托管人住所

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 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	国泰国证有色金属行业 指数 A	国泰国证有色金属行业指 数 C
本期已实现收益	-14,798,338.64	-491,200.01
本期利润	-15,145,046.07	3,225,737.08
加权平均基金份额本期利润	-0.0112	0.0828
本期加权平均净值利润率	-0.85%	6.18%
本期基金份额净值增长率	-1.66%	-1.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	国泰国证有色金属行业指 数 A	国泰国证有色金属行业指数 C
期末可供分配利润	-121,895,224.19	7,715,235.50
期末可供分配基金份额利润	-0.0915	0.2255
期末基金资产净值	1,635,749,829.07	41,934,888.05
期末基金份额净值	1.2275	1.2255

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	国泰国证有色金属行业指数 A	国泰国证有色金属行业指数 C
基金份额累计净值增长率	11.33%	-6.11%

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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰国证有色金属行业指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.56%	1.20%	-0.13%	1.21%	0.69%	-0.01%
过去三个月	-8.02%	1.28%	-9.21%	1.30%	1.19%	-0.02%
过去六个月	-1.66%	1.27%	-2.74%	1.29%	1.08%	-0.02%
过去一年	-16.29%	1.39%	-19.02%	1.45%	2.73%	-0.06%
自基金合同生效起至今	11.33%	1.96%	3.28%	2.00%	8.05%	-0.04%

国泰国证有色金属行业指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.54%	1.20%	-0.13%	1.21%	0.67%	-0.01%
过去三个月	-8.07%	1.28%	-9.21%	1.30%	1.14%	-0.02%
过去六个月	-1.76%	1.27%	-2.74%	1.29%	0.98%	-0.02%
过去一年	-16.52%	1.39%	-19.02%	1.45%	2.50%	-0.06%
自新增 C 类份额起至今	-6.11%	1.44%	-8.62%	1.50%	2.51%	-0.06%

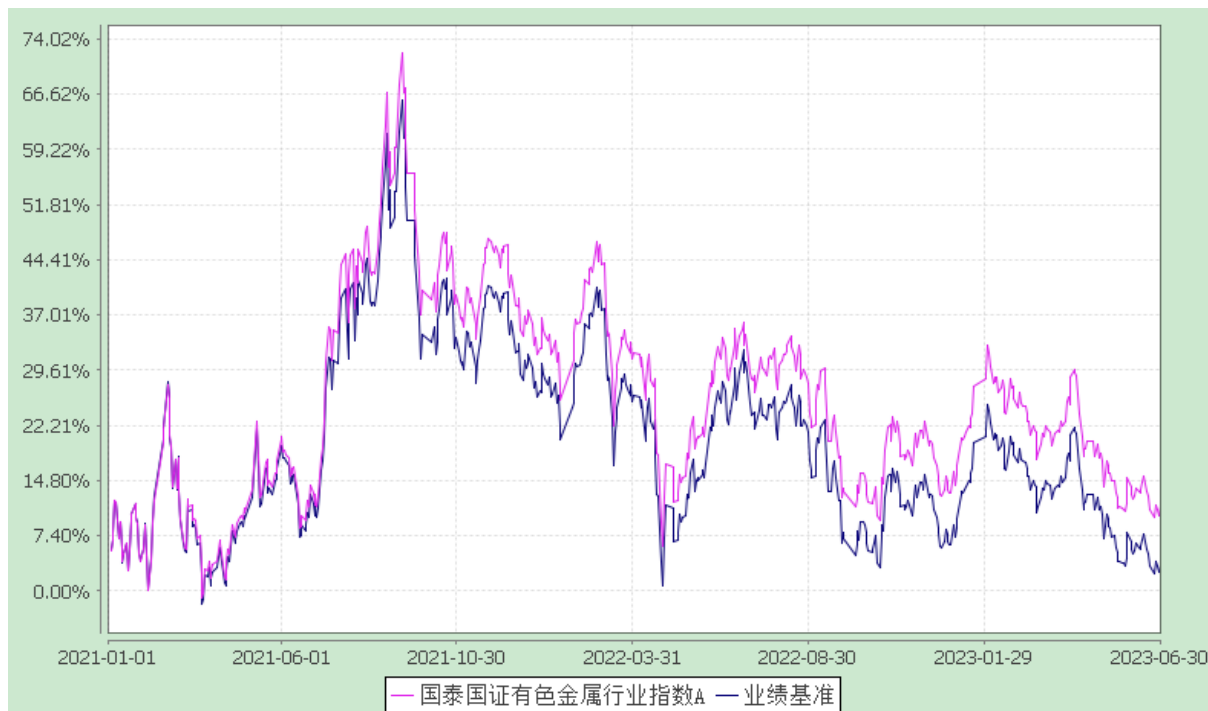
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰国证有色金属行业指数证券投资基金

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

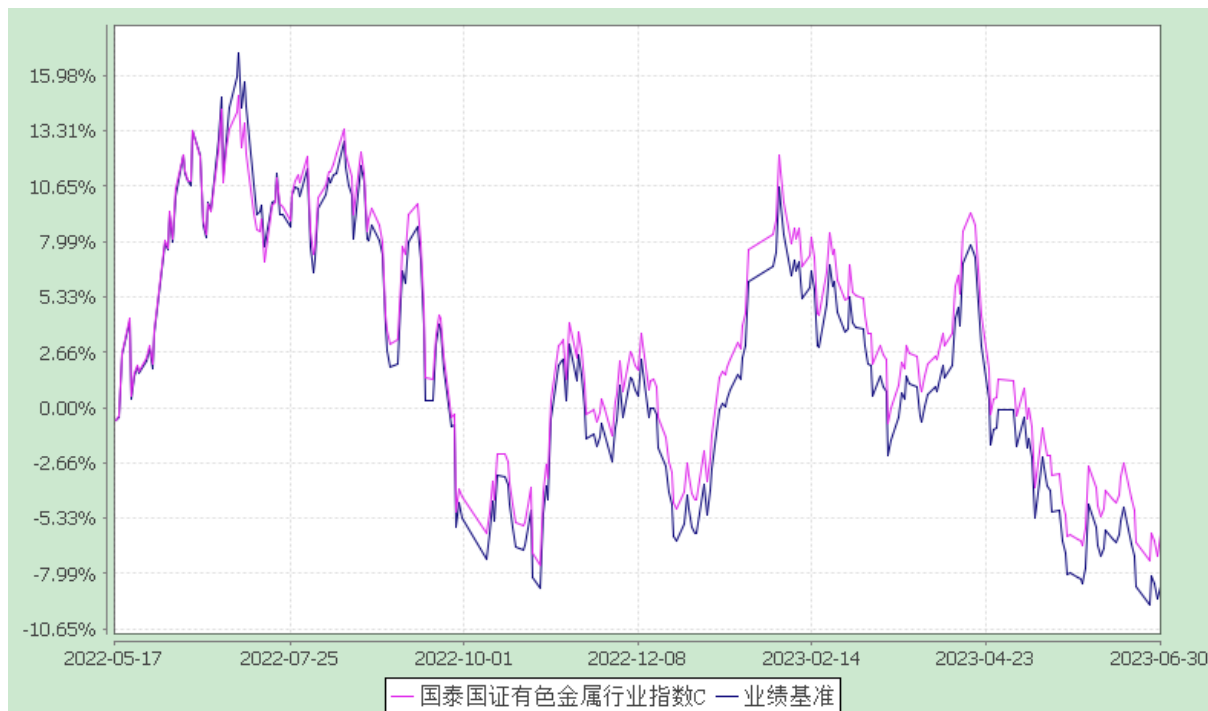
(2021 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日)

国泰国证有色金属行业指数 A



注：本基金的合同生效日为 2021 年 1 月 1 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

国泰国证有色金属行业指数 C



注：(1)本基金的合同生效日为 2021 年 1 月 1 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

(2)自 2022 年 5 月 17 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 244 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

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		
吴中昊	国泰中证 500 指数增强、国泰中证内地运输主题 ETF、国泰沪深 300 指数增强、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证有色金属行业指数、国泰上证综合 ETF、国泰沪深 300 指数、国泰国证房地产行业指数、国泰沪深 300 增强策略	2022-12-30	-	8 年	硕士研究生。曾任职于 Arrowstreet Capital（美国）。2019 年 12 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2022 年 1 月起任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2022 年 11 月起兼任国泰中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金和国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投

	ETF、国泰中证 1000 增强策略 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证煤炭 ETF、国泰创业板指数 (LOF)、国泰中证香港内地国有企业 ETF (QDII) 的基金经理				资基金的基金经理，2023 年 2 月起兼任国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

(一) 本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1% 数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95% 置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值普遍在 1% 数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A 股上半年整体波动较大。一季度受到大语言模型 ChatGPT 及其突破性的用户交互体验的影响，计算机，通信，传媒等 TMT 板块受到了投资人的追捧，成交活跃，带动 A 股震荡抬升。二季度经济复苏不及预期，5 月的出口数据走弱，出口金额同比下降 7.5%，CPI 和 PPI 同比继续走低。投资人风险偏好下降，投资由一季度的概念导向转向业绩导向，使得市场整体呈现快速轮转的效应。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为-1.66%，同期业绩比较基准收益率为-2.74%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-1.76%，同期业绩比较基准收益率为-2.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

如何提振消费仍然是经济复苏的核心问题。在货币政策效果不及预期的情况下，经济的恢复期可能要持续的更长，这很大程度上影响了投资人的风险偏好。下半年是否会出现财政刺激，财政、

货币政策如何形成合力，接下来的政策“组合拳”可能是推动 A 股走势的核心。除此之外，AI 作为跨时代的产物，仍具有很强的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰国证有色金属行业指数证券投资基金

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	6.4.7.1	129,113,828.16	77,785,031.50
结算备付金		-	304,923.25
存出保证金		56,079.12	94,835.97
交易性金融资产	6.4.7.2	1,562,078,976.89	1,727,323,124.39
其中：股票投资		1,562,078,976.89	1,696,400,571.75
基金投资		-	-
债券投资		-	30,922,552.64
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	45,434,775.36
应收股利		1,100,597.96	10,300.00
应收申购款		3,193,055.60	2,173,562.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	113,632.00	148,105.49
资产总计		1,695,656,169.73	1,853,274,658.76
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 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		-	-
应付清算款		9,980,705.67	38,419,957.38

应付赎回款		5,513,398.66	3,717,669.04
应付管理人报酬		1,392,542.37	1,597,256.06
应付托管费		306,359.33	351,396.34
应付销售服务费		5,955.26	8,792.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		17,212.83	15,832.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	755,278.49	807,856.56
负债合计		17,971,452.61	44,918,760.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,791,864,705.81	1,897,629,278.39
未分配利润	6.4.7.8	-114,179,988.69	-89,273,380.40
净资产合计		1,677,684,717.12	1,808,355,897.99
负债和净资产总计		1,695,656,169.73	1,853,274,658.76

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,366,785,791.51 份，其中国泰国证有色金属行业指数 A 类基金份额净值 1.2275 元，A 类基金份额总额 1,332,566,138.96 份；国泰国证有色金属行业指数 C 类基金份额净值 1.2255 元，C 类基金份额总额 34,219,652.55 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰国证有色金属行业指数证券投资基金

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		-396,464.25	-67,005,300.28
1.利息收入		2,552,260.75	935,742.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	234,785.22	128,990.67
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		2,317,475.53	806,751.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,200,557.07	58,126,125.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-29,668,125.46	37,835,453.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-29,931.99	3,493,462.76
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	22,497,500.38	16,797,209.65
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	3,370,229.66	-129,115,994.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	881,602.41	3,048,826.82
减：二、营业总支出		11,522,844.74	13,538,001.78
1. 管理人报酬		9,155,980.07	10,827,036.29
2. 托管费		2,014,315.60	2,381,947.99
3. 销售服务费		51,540.07	0.06
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		8,343.93	2,921.88
8. 其他费用	6.4.7.16	292,665.07	326,095.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,919,308.99	-80,543,302.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,919,308.99	-80,543,302.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-11,919,308.99	-80,543,302.06

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰国证有色金属行业指数证券投资基金

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,897,629,278.39	-89,273,380.40	1,808,355,897.99
二、本期期初净资产（基金净值）	1,897,629,278.39	-89,273,380.40	1,808,355,897.99
三、本期增减变动额（减少以	-105,764,572.58	-24,906,608.29	-130,671,180.87

“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	-11,919,308.99	-11,919,308.99
(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)	-105,764,572.58	-12,987,299.30	-118,751,871.88
其中: 1.基金申购款	530,702,280.05	29,121,201.67	559,823,481.72
2.基金赎回款	-636,466,852.63	-42,108,500.97	-678,575,353.60
(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、本期期末净资产(基金净值)	1,791,864,705.81	-114,179,988.69	1,677,684,717.12
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,218,595,130.15	335,429,526.47	2,554,024,656.62
二、本期期初净资产(基金净值)	2,218,595,130.15	335,429,526.47	2,554,024,656.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-324,763,866.70	-123,903,517.93	-448,667,384.63
(一)、综合收益总额	-	-80,543,302.06	-80,543,302.06
(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)	-324,763,866.70	-43,360,215.87	-368,124,082.57
其中: 1.基金申购款	1,080,898,484.88	92,365,824.76	1,173,264,309.64
2.基金赎回款	-1,405,662,351.58	-135,726,040.63	-1,541,388,392.21
(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、本期期末净资产（基金净值）	1,893,831,263.45	211,526,008.54	2,105,357,271.99

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：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰国证有色金属行业指数证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据《关于国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金修订基金合同的公告》以及相关法律法规的相关规定，由原国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原基金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[2014]360 号《关于核准国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 416,538,499.98 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 238 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 3 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 416,573,209.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 34,709.70 份基金份额。根据本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2020 年 12 月 2 日发布的《关于国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金之有色 A 份额和有色 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，原基金于份额折算日基准日 2020 年 12 月 31 日日终将有色 A 份额和有色 B 份额折算为国泰有色份额。国泰国证有色金属行业指数证券投资基金基金合同》和《国泰国证有色金属行业指数证券投资基金托管协议》自 2021 年 1 月 1 日起生效，原《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金基金合同》和《国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金托管协议》自同日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

原基金于基金合同失效前的基金资产净值为 2,889,132,272.10 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]第 57 号文审核同意, 本基金 520,605,254.00 份基金份额于 2021 年 1 月 20 日在深交所挂牌交易。

根据基金管理人国泰基金管理有限公司于 2022 年 5 月 13 日发布的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同的公告》的规定, 经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案, 自 2022 年 5 月 17 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 但不从本类别基金资产中计提销售服务费(原基金份额自动转入 A 类基金份额); C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 且从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码, 分别计算并公布基金份额净值。投资人可自行选择申购的基金份额类别, 但不同类别基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰国证有色金属行业指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括标的指数成份股及其备选成份股(含存托凭证)、债券、债券回购、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%, 其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于股票资产的 90%, 且不低于非现金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。权证投资不高于基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准: 国证有色金属行业指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰国证有色金属行业指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中

国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债

以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	129,113,828.16
等于：本金	129,101,879.95
加：应计利息	11,948.21
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	129,113,828.16

6.4.7.2 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		1,675,810,045.12	-	1,562,078,976.89	-113,731,068.23
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		1,675,810,045.12	-	1,562,078,976.89	-113,731,068.23

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 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	-
待摊费用	-
应计转融通出借证券利息	113,632.00
合计	113,632.00

6.4.7.6 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	20,722.84
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	537,504.76
其中：交易所市场	537,504.76
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
应付指数使用费	87,954.95
合计	755,278.49

6.4.7.7 实收基金

国泰国证有色金属行业指数 A

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	账面金额
上年度末	1,407,120,135.96	1,855,981,866.33
本期申购	346,459,931.85	456,978,783.01
本期赎回（以“-”号填列）	-421,013,928.85	-555,315,596.08
本期末	1,332,566,138.96	1,757,645,053.26

注：1：截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金 A 类于深交所上市的基金份额为 44,712,463.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 1,287,853,675.96。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

2：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

国泰国证有色金属行业指数 C

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	账面金额
上年度末	41,647,412.06	41,647,412.06
本期申购	73,723,497.04	73,723,497.04
本期赎回（以“-”号填列）	-81,151,256.55	-81,151,256.55
本期末	34,219,652.55	34,219,652.55

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰国证有色金属行业指数 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-53,074,328.99	-46,503,495.70	-99,577,824.69
本期利润	-14,798,338.64	-346,707.43	-15,145,046.07
本期基金份额交易产生的变动数	3,424,055.68	-10,596,409.11	-7,172,353.43
其中：基金申购款	-14,613,999.11	19,151,129.48	4,537,130.37
基金赎回款	18,038,054.79	-29,747,538.59	-11,709,483.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-64,448,611.95	-57,446,612.24	-121,895,224.19

国泰国证有色金属行业指数 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,673,735.96	-1,369,291.67	10,304,444.29
本期利润	-491,200.01	3,716,937.09	3,225,737.08
本期基金份额交易产生的变动数	-2,001,651.87	-3,813,294.00	-5,814,945.87
其中：基金申购款	20,269,659.57	4,314,411.73	24,584,071.30
基金赎回款	-22,271,311.44	-8,127,705.73	-30,399,017.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,180,884.08	-1,465,648.58	7,715,235.50

6.4.7.9 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	232,648.86
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	1,433.29
其他	703.07
合计	234,785.22

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	476,411,807.27
减：卖出股票成本总额	504,852,522.81
减：交易费用	1,227,409.92
买卖股票差价收入	-29,668,125.46

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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	5,939.83
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-35,871.82
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	-29,931.99

6.4.7.11.2 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	30,928,627.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,342,975.92
减：应计利息总额	621,523.47
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-35,871.82

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 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	22,497,500.38
其中：证券出借权益补偿收入	4,372,827.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	22,497,500.38

6.4.7.14 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	3,370,229.66
——股票投资	3,334,222.74
——债券投资	36,006.92
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	3,370,229.66

6.4.7.15 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	881,602.41
合计	881,602.41

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.16 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	449.54
指数使用费	183,119.59
合计	292,665.07

注：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 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000.00 元。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人

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

本基金本报告期内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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	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	9,155,980.07	10,827,036.29
其中：支付销售机构的客户维护费	3,489,695.59	4,250,985.97

注：支付基金管理人国泰基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%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 X 1.0% / 当年天数。

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
	2023年1月1日至2023年6月30日	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	2,014,315.60	2,381,947.99

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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 X 0.22% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰国证有色金属行业指数 A	国泰国证有色金属行业指数 C	合计
国泰基金管理有限公司	-	218.34	218.34
合计	-	218.34	218.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰国证有色金属行业指数A	国泰国证有色金属行业指数C	合计
国泰基金管理有限公司	-	0.06	0.06
合计	-	0.06	0.06

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.20%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

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无与关联方进行的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均未有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。

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均未有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。

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

份额单位：份

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	
	国泰国证有色金属行业指数A	国泰国证有色金属行业指数C	国泰国证有色金属行业指数A	国泰国证有色金属行业指数C
基金合同生效日 (2021年1月1日) 持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	75,826.51	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份	-	75,826.51	-	-

额				
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.01%	-	-

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

国泰国证有色金属行业指数 A

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
国泰元鑫资产管理有限公司	2,378,264.21	0.18%	2,378,264.21	0.17%

国泰国证有色金属行业指数 C

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		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
中国建设银行	129,113,828.16	232,648.86	29,395,323.31	119,452.03

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间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

本基金本报告期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

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2023 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.86	18.06	7,405.00	147,063.30	133,734.30	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.10	17.04	6,261.00	69,497.10	106,687.44	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	网下中签流通受限	39.78	39.78	2,356.00	93,721.68	93,721.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	网下中签流通受限	25.82	25.82	3,060.00	79,009.20	79,009.20	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.77	42.89	1,840.00	43,736.80	78,917.60	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	5.69	5.41	13,800.00	78,522.00	74,658.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	网下中签流通受限	36.90	36.90	1,973.00	72,803.70	72,803.70	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.60	64.67	831.00	19,611.60	53,740.77	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月以上	新股锁定流通	39.99	36.71	1,008.00	40,309.92	37,003.68	-

				受限						
00128 6	陕西 能源	2023-0 3-31	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	9.60	9.41	3,767. 00	36,163 .20	35,447 .47	-
60106 1	中信 金属	2023-0 3-30	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	6.58	7.58	4,016. 00	26,425 .28	30,441 .28	-
68835 2	颀中 科技	2023-0 4-11	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	12.10	12.07	2,361. 00	28,568 .10	28,497 .27	-
30129 3	三博 脑科	2023-0 4-25	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	29.60	71.42	333.00	9,856. 80	23,782 .86	-
68855 2	航天 南湖	2023-0 5-08	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	21.17	23.50	956.00	20,238 .52	22,466 .00	-
68857 0	天玛 智控	2023-0 5-29	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	30.26	25.33	884.00	26,749 .84	22,391 .72	-
68854 3	国科 军工	2023-0 6-14	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	43.67	53.05	410.00	17,904 .70	21,750 .50	-
68845 8	美芯 晟	2023-0 5-15	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	75.00	90.76	221.00	16,575 .00	20,057 .96	-
68858 1	安杰 思	2023-0 5-12	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	125.80	118.03	163.00	20,505 .40	19,238 .89	-
68850 7	索辰 科技	2023-0 4-10	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	245.56	122.11	150.00	36,834 .00	18,316 .50	-
68847 8	晶升 股份	2023-0 4-13	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	32.52	42.37	402.00	13,073 .04	17,032 .74	-

688562	航天软件	2023-05-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.68	22.31	726.00	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.99	16.90	949.00	18,970.51	16,038.10	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	14.81	13.73	1,122.00	16,616.82	15,405.06	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	14.16	16.21	888.00	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.18	14.59	959.00	10,721.62	13,991.81	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.66	31.50	418.00	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.68	12.34	1,016.00	10,850.88	12,537.44	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	73.45	46.64	266.00	19,537.70	12,406.24	-
30148	豪恩	2023-0	6 个月	新股	39.78	39.78	262.00	10,422	10,422	-

8	汽电	6-26	以上	锁定 流通 受限				.36	.36	
688479	友车科技	2023-05-04	6个月以上	新股 锁定 流通 受限	33.99	29.49	332.00	11,284.68	9,790.68	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月以上	新股 锁定 流通 受限	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6个月以上	新股 锁定 流通 受限	19.20	25.53	346.00	6,643.20	8,833.38	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6个月(含)	送股	-	122.11	72.00	-	8,791.92	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月以上	新股 锁定 流通 受限	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月以上	新股 锁定 流通 受限	11.66	12.26	664.00	7,742.24	8,140.64	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6个月以上	新股 锁定 流通 受限	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月以上	新股 锁定 流通 受限	46.13	34.40	225.00	10,379.25	7,740.00	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月以上	新股 锁定 流通 受限	32.60	30.37	232.00	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月以上	新股 锁定 流通 受限	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月以上	新股 锁定 流通	25.98	24.53	160.00	4,156.80	3,924.80	-

				受限						
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	20.68	25.49	145.00	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.38	14.87	177.00	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-

注：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设定限售期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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末	数量(单位)	期末估值总
----	------	------	-------	----	--------	-------

				估值 单价	股)	额
1	002466	天齐锂业	2023年6月30日 -2023年7月14日	69.91	69,000.00	4,823,790.00
2	002466	天齐锂业	2023年6月30日 -2023年7月14日	69.91	69,000.00	4,823,790.00
3	002466	天齐锂业	2023年6月30日 -2023年7月14日	69.91	69,000.00	4,823,790.00
4	002466	天齐锂业	2023年6月30日 -2023年7月14日	69.91	69,000.00	4,823,790.00
5	002460	赣锋锂业	2023年6月26日 -2023年7月10日	60.96	75,000.00	4,572,000.00
6	002460	赣锋锂业	2023年6月26日 -2023年7月10日	60.96	75,000.00	4,572,000.00
7	601899	紫金矿业	2023年6月13日 -2023年7月11日	11.37	401,900.00	4,569,603.00
8	603799	华友钴业	2023年6月29日 -2023年7月13日	45.91	91,900.00	4,219,129.00
9	603799	华友钴业	2023年6月28日 -2023年7月12日	45.91	86,000.00	3,948,260.00
10	603799	华友钴业	2023年6月28日 -2023年7月12日	45.91	86,000.00	3,948,260.00
11	600111	北方稀土	2023年6月29日 -2023年7月13日	23.98	154,000.00	3,692,920.00
12	600111	北方稀土	2023年6月29日 -2023年7月13日	23.98	154,000.00	3,692,920.00
13	600111	北方稀土	2023年6月29日 -2023年7月13日	23.98	154,000.00	3,692,920.00
14	002460	赣锋锂业	2023年6月26日 -2023年7月10日	60.96	60,400.00	3,681,984.00
15	603799	华友钴业	2023年6月19日 -2023年7月3日	45.91	80,000.00	3,672,800.00
16	600111	北方稀土	2023年6月26日 -2023年7月10日	23.98	147,000.00	3,525,060.00
17	603799	华友钴业	2023年6月19日 -2023年7月3日	45.91	72,500.00	3,328,475.00
18	002460	赣锋锂业	2023年6月26日 -2023年7月3日	60.96	50,000.00	3,048,000.00
19	002738	中矿资源	2023年6月29日 -2023年7月13日	50.94	46,000.00	2,343,240.00
20	601899	紫金矿业	2023年6月26日 -2023年7月3日	11.37	200,000.00	2,274,000.00
21	002466	天齐锂业	2023年6月27日 -2023年7月11日	69.91	32,000.00	2,237,120.00

22	002466	天齐锂业	2023年6月13日 -2023年7月11日	69.91	27,600.00	1,929,516.00
23	603799	华友钴业	2023年6月29日 -2023年7月27日	45.91	41,700.00	1,914,447.00
24	600489	中金黄金	2023年6月26日 -2023年7月10日	10.33	184,000.00	1,900,720.00
25	002466	天齐锂业	2023年6月20日 -2023年7月4日	69.91	27,000.00	1,887,570.00
26	002460	赣锋锂业	2023年6月13日 -2023年7月11日	60.96	30,000.00	1,828,800.00
27	000807	云铝股份	2023年6月30日 -2023年7月14日	12.73	141,000.00	1,794,930.00
28	603799	华友钴业	2023年6月26日 -2023年7月24日	45.91	33,800.00	1,551,758.00
29	603799	华友钴业	2023年6月13日 -2023年7月11日	45.91	33,700.00	1,547,167.00
30	600111	北方稀土	2023年6月13日 -2023年7月11日	23.98	63,500.00	1,522,730.00
31	000807	云铝股份	2023年6月27日 -2023年7月11日	12.73	119,500.00	1,521,235.00
32	002738	中矿资源	2023年6月26日 -2023年7月10日	50.94	28,400.00	1,446,696.00
33	600111	北方稀土	2023年6月13日 -2023年7月11日	23.98	60,000.00	1,438,800.00
34	600111	北方稀土	2023年6月27日 -2023年7月11日	23.98	58,700.00	1,407,626.00
35	002466	天齐锂业	2023年6月26日 -2023年7月24日	69.91	20,000.00	1,398,200.00
36	002466	天齐锂业	2023年6月26日 -2023年7月10日	69.91	20,000.00	1,398,200.00
37	600988	赤峰黄金	2023年6月26日 -2023年7月10日	13.46	100,000.00	1,346,000.00
38	600988	赤峰黄金	2023年6月19日 -2023年7月3日	13.46	100,000.00	1,346,000.00
39	603799	华友钴业	2023年6月16日 -2023年7月14日	45.91	29,000.00	1,331,390.00
40	002738	中矿资源	2023年6月29日 -2023年7月27日	50.94	25,000.00	1,273,500.00
41	002738	中矿资源	2023年6月28日 -2023年7月5日	50.94	25,000.00	1,273,500.00
42	002738	中矿资源	2023年6月28日 -2023年7月5日	50.94	25,000.00	1,273,500.00
43	002738	中矿资源	2023年6月26日 -2023年7月10日	50.94	24,000.00	1,222,560.00

44	601600	中国铝业	2023年6月13日 -2023年7月11日	5.49	216,800.00	1,190,232.00
45	002497	雅化集团	2023年6月27日 -2023年7月11日	17.78	60,000.00	1,066,800.00
46	002497	雅化集团	2023年6月27日 -2023年7月11日	17.78	60,000.00	1,066,800.00
47	603993	洛阳钼业	2023年6月13日 -2023年7月11日	5.33	194,900.00	1,038,817.00
48	600547	山东黄金	2023年6月13日 -2023年7月11日	23.48	43,900.00	1,030,772.00
49	000933	神火股份	2023年6月9日 -2023年7月7日	13.00	79,000.00	1,027,000.00
50	000629	钒钛股份	2023年6月28日 -2023年7月5日	3.91	262,000.00	1,024,420.00
51	000629	钒钛股份	2023年6月28日 -2023年7月5日	3.91	262,000.00	1,024,420.00
52	002738	中矿资源	2023年6月27日 -2023年7月11日	50.94	20,000.00	1,018,800.00
53	002756	永兴材料	2023年6月19日 -2023年7月3日	62.61	16,000.00	1,001,760.00
54	002497	雅化集团	2023年6月26日 -2023年7月10日	17.78	56,000.00	995,680.00
55	002497	雅化集团	2023年6月26日 -2023年7月10日	17.78	56,000.00	995,680.00
56	000960	锡业股份	2023年6月20日 -2023年7月4日	15.55	64,000.00	995,200.00
57	000960	锡业股份	2023年6月20日 -2023年7月4日	15.55	64,000.00	995,200.00
58	000960	锡业股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	15.55	64,000.00	995,200.00
59	000960	锡业股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	15.55	64,000.00	995,200.00
60	002738	中矿资源	2023年6月20日 -2023年7月4日	50.94	19,300.00	983,142.00
61	000807	云铝股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	12.73	77,200.00	982,756.00
62	000629	钒钛股份	2023年6月9日 -2023年7月7日	3.91	249,100.00	973,981.00
63	000933	神火股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	13.00	74,500.00	968,500.00
64	000831	中国稀土	2023年6月19日 -2023年7月3日	29.60	31,900.00	944,240.00
65	000807	云铝股份	2023年6月12日 -2023年7月10日	12.73	72,500.00	922,925.00

66	603799	华友钴业	2023年6月29日 -2023年7月13日	45.91	20,000.00	918,200.00
67	603799	华友钴业	2023年6月29日 -2023年7月13日	45.91	20,000.00	918,200.00
68	002203	海亮股份	2023年6月26日 -2023年7月3日	12.01	76,000.00	912,760.00
69	000831	中国稀土	2023年6月26日 -2023年7月10日	29.60	30,700.00	908,720.00
70	000629	钒钛股份	2023年6月28日 -2023年7月12日	3.91	227,300.00	888,743.00
71	601600	中国铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	5.49	160,000.00	878,400.00
72	002192	融捷股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	66.83	13,000.00	868,790.00
73	002192	融捷股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	66.83	13,000.00	868,790.00
74	002192	融捷股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	66.83	13,000.00	868,790.00
75	002192	融捷股份	2023年6月28日 -2023年7月12日	66.83	13,000.00	868,790.00
76	600489	中金黄金	2023年6月26日 -2023年7月10日	10.33	84,000.00	867,720.00
77	002460	赣锋锂业	2023年6月13日 -2023年7月11日	60.96	14,200.00	865,632.00
78	002466	天齐锂业	2023年6月13日 -2023年7月11日	69.91	12,200.00	852,902.00
79	601899	紫金矿业	2023年6月8日 -2023年7月6日	11.37	74,600.00	848,202.00
80	000831	中国稀土	2023年6月19日 -2023年7月3日	29.60	28,400.00	840,640.00
81	000807	云铝股份	2023年6月8日 -2023年7月6日	12.73	65,700.00	836,361.00
82	000762	西藏矿业	2023年6月27日 -2023年7月11日	29.63	27,800.00	823,714.00
83	000970	中科三环	2023年6月27日 -2023年7月11日	12.82	64,000.00	820,480.00
84	002203	海亮股份	2023年6月30日 -2023年7月14日	12.01	67,900.00	815,479.00
85	002756	永兴材料	2023年6月29日 -2023年7月13日	62.61	13,000.00	813,930.00
86	000060	中金岭南	2023年6月29日 -2023年7月13日	4.75	168,000.00	798,000.00
87	000933	神火股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	13.00	60,500.00	786,500.00

88	000970	中科三环	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	12.82	61,000.00	782,020.00
89	000629	钒钛股份	2023 年 6 月 12 日 -2023 年 7 月 10 日	3.91	200,000.00	782,000.00
90	000970	中科三环	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	12.82	60,900.00	780,738.00
91	000831	中国稀土	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	29.60	26,000.00	769,600.00
92	002466	天齐锂业	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	69.91	11,000.00	769,010.00
93	600489	中金黄金	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	10.33	73,100.00	755,123.00
94	000807	云铝股份	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	12.73	59,000.00	751,070.00
95	601899	紫金矿业	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	11.37	66,000.00	750,420.00
96	601677	明泰铝业	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 3 日	13.88	54,000.00	749,520.00
97	601677	明泰铝业	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	13.88	54,000.00	749,520.00
98	000960	锡业股份	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	15.55	47,800.00	743,290.00
99	600988	赤峰黄金	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	13.46	54,200.00	729,532.00
100	300748	金力永磁	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	29.92	24,000.00	718,080.00
101	300748	金力永磁	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 7 日	29.92	24,000.00	718,080.00
102	002738	中矿资源	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	50.94	14,000.00	713,160.00
103	000807	云铝股份	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	12.73	55,900.00	711,607.00
104	002192	融捷股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	66.83	10,600.00	708,398.00
105	002466	天齐锂业	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	69.91	10,000.00	699,100.00
106	002738	中矿资源	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	50.94	13,700.00	697,878.00
107	601677	明泰铝业	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	13.88	50,000.00	694,000.00
108	000762	西藏矿业	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	29.63	23,000.00	681,490.00
109	600489	中金黄金	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	10.33	65,400.00	675,582.00

110	600489	中金黄金	2023年6月12日 -2023年7月10日	10.33	65,300.00	674,549.00
111	000831	中国稀土	2023年6月20日 -2023年7月4日	29.60	22,700.00	671,920.00
112	002192	融捷股份	2023年6月29日 -2023年7月27日	66.83	10,000.00	668,300.00
113	600988	赤峰黄金	2023年6月16日 -2023年7月14日	13.46	49,000.00	659,540.00
114	600988	赤峰黄金	2023年6月21日 -2023年7月19日	13.46	49,000.00	659,540.00
115	600338	西藏珠峰	2023年6月28日 -2023年7月26日	18.26	35,500.00	648,230.00
116	601958	金钼股份	2023年6月27日 -2023年7月11日	11.15	58,000.00	646,700.00
117	600489	中金黄金	2023年6月27日 -2023年7月11日	10.33	62,600.00	646,658.00
118	000831	中国稀土	2023年6月26日 -2023年7月10日	29.60	21,800.00	645,280.00
119	603799	华友钴业	2023年6月27日 -2023年7月11日	45.91	14,000.00	642,740.00
120	000970	中科三环	2023年6月20日 -2023年7月4日	12.82	50,000.00	641,000.00
121	601600	中国铝业	2023年6月26日 -2023年7月10日	5.49	116,000.00	636,840.00
122	000060	中金岭南	2023年6月20日 -2023年7月4日	4.75	132,000.00	627,000.00
123	000762	西藏矿业	2023年6月20日 -2023年7月4日	29.63	20,600.00	610,378.00
124	002460	赣锋锂业	2023年6月30日 -2023年7月28日	60.96	10,000.00	609,600.00
125	600362	江西铜业	2023年6月20日 -2023年7月4日	18.98	32,000.00	607,360.00
126	002497	雅化集团	2023年6月27日 -2023年7月11日	17.78	33,900.00	602,742.00
127	002203	海亮股份	2023年6月20日 -2023年7月4日	12.01	50,000.00	600,500.00
128	000762	西藏矿业	2023年6月13日 -2023年7月11日	29.63	20,000.00	592,600.00
129	002460	赣锋锂业	2023年6月19日 -2023年7月3日	60.96	9,600.00	585,216.00
130	000629	钒钛股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	3.91	148,000.00	578,680.00
131	002155	湖南黄金	2023年6月26日 -2023年7月24日	12.20	47,400.00	578,280.00

132	300748	金力永磁	2023年6月27日 -2023年7月25日	29.92	19,300.00	577,456.00
133	601677	明泰铝业	2023年6月29日 -2023年7月27日	13.88	41,600.00	577,408.00
134	000975	银泰黄金	2023年6月13日 -2023年7月11日	11.70	49,200.00	575,640.00
135	600338	西藏珠峰	2023年6月30日 -2023年7月28日	18.26	31,400.00	573,364.00
136	601600	中国铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	5.49	100,000.00	549,000.00
137	600988	赤峰黄金	2023年6月20日 -2023年7月18日	13.46	40,700.00	547,822.00
138	600456	宝钛股份	2023年6月27日 -2023年7月11日	33.84	16,000.00	541,440.00
139	600456	宝钛股份	2023年6月30日 -2023年7月14日	33.84	16,000.00	541,440.00
140	300748	金力永磁	2023年6月30日 -2023年7月28日	29.92	18,000.00	538,560.00
141	000630	铜陵有色	2023年6月13日 -2023年7月11日	2.89	185,900.00	537,251.00
142	000831	中国稀土	2023年6月26日 -2023年7月10日	29.60	18,100.00	535,760.00
143	601958	金钼股份	2023年6月20日 -2023年7月4日	11.15	48,000.00	535,200.00
144	002192	融捷股份	2023年6月20日 -2023年7月4日	66.83	8,000.00	534,640.00
145	000933	神火股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	13.00	41,100.00	534,300.00
146	600988	赤峰黄金	2023年6月13日 -2023年7月11日	13.46	39,600.00	533,016.00
147	000933	神火股份	2023年6月27日 -2023年7月11日	13.00	41,000.00	533,000.00
148	600489	中金黄金	2023年6月26日 -2023年7月24日	10.33	51,000.00	526,830.00
149	603876	鼎胜新材	2023年6月28日 -2023年7月26日	19.19	27,000.00	518,130.00
150	600547	山东黄金	2023年6月29日 -2023年7月27日	23.48	22,000.00	516,560.00
151	002756	永兴材料	2023年6月13日 -2023年7月11日	62.61	8,200.00	513,402.00
152	002738	中矿资源	2023年6月20日 -2023年7月18日	50.94	10,000.00	509,400.00
153	002738	中矿资源	2023年6月28日 -2023年7月5日	50.94	10,000.00	509,400.00

154	002738	中矿资源	2023年6月26日 -2023年7月3日	50.94	10,000.00	509,400.00
155	000831	中国稀土	2023年6月26日 -2023年7月3日	29.60	17,100.00	506,160.00
156	600219	南山铝业	2023年6月13日 -2023年7月11日	3.02	165,700.00	500,414.00
157	601958	金钼股份	2023年6月29日 -2023年7月27日	11.15	44,300.00	493,945.00
158	000629	钒钛股份	2023年6月28日 -2023年7月5日	3.91	125,100.00	489,141.00
159	002497	雅化集团	2023年6月13日 -2023年7月11日	17.78	27,400.00	487,172.00
160	300618	寒锐钴业	2023年6月20日 -2023年7月18日	32.41	15,000.00	486,150.00
161	300618	寒锐钴业	2023年6月19日 -2023年7月17日	32.41	15,000.00	486,150.00
162	601168	西部矿业	2023年6月13日 -2023年7月11日	10.51	46,100.00	484,511.00
163	601168	西部矿业	2023年6月7日 -2023年7月5日	10.51	45,700.00	480,307.00
164	603876	鼎胜新材	2023年6月21日 -2023年7月5日	19.19	25,000.00	479,750.00
165	600673	东阳光	2023年6月30日 -2023年7月14日	7.21	66,000.00	475,860.00
166	600673	东阳光	2023年6月30日 -2023年7月14日	7.21	66,000.00	475,860.00
167	000060	中金岭南	2023年6月29日 -2023年7月13日	4.75	100,000.00	475,000.00
168	002532	天山铝业	2023年6月27日 -2023年7月11日	5.99	78,900.00	472,611.00
169	601600	中国铝业	2023年6月20日 -2023年7月4日	5.49	86,000.00	472,140.00
170	000960	锡业股份	2023年6月21日 -2023年7月5日	15.55	30,000.00	466,500.00
171	002203	海亮股份	2023年6月15日 -2023年7月13日	12.01	38,700.00	464,787.00
172	600392	盛和资源	2023年6月13日 -2023年7月11日	12.87	36,000.00	463,320.00
173	601600	中国铝业	2023年6月21日 -2023年7月5日	5.49	84,000.00	461,160.00
174	600362	江西铜业	2023年6月13日 -2023年7月11日	18.98	24,200.00	459,316.00
175	603799	华友钴业	2023年6月20日 -2023年7月18日	45.91	10,000.00	459,100.00

176	600259	广晟有色	2023年6月26日 -2023年7月10日	36.14	12,700.00	458,978.00
177	601600	中国铝业	2023年6月15日 -2023年7月13日	5.49	83,300.00	457,317.00
178	600338	西藏珠峰	2023年6月27日 -2023年7月11日	18.26	25,000.00	456,500.00
179	300618	寒锐钴业	2023年6月26日 -2023年7月10日	32.41	14,000.00	453,740.00
180	002497	雅化集团	2023年6月19日 -2023年7月3日	17.78	25,300.00	449,834.00
181	600338	西藏珠峰	2023年6月27日 -2023年7月11日	18.26	24,500.00	447,370.00
182	000975	银泰黄金	2023年6月8日 -2023年7月6日	11.70	37,900.00	443,430.00
183	601600	中国铝业	2023年6月8日 -2023年7月6日	5.49	80,600.00	442,494.00
184	600497	驰宏锌锗	2023年6月13日 -2023年7月11日	5.02	87,600.00	439,752.00
185	600111	北方稀土	2023年6月19日 -2023年7月3日	23.98	18,300.00	438,834.00
186	000629	钒钛股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	3.91	110,700.00	432,837.00
187	000762	西藏矿业	2023年6月26日 -2023年7月10日	29.63	14,600.00	432,598.00
188	000933	神火股份	2023年6月12日 -2023年7月10日	13.00	32,700.00	425,100.00
189	000878	云南铜业	2023年6月13日 -2023年7月11日	11.05	38,000.00	419,900.00
190	000629	钒钛股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	3.91	106,600.00	416,806.00
191	603876	鼎胜新材	2023年6月29日 -2023年7月27日	19.19	21,700.00	416,423.00
192	601677	明泰铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	13.88	30,000.00	416,400.00
193	300748	金力永磁	2023年6月30日 -2023年7月14日	29.92	13,900.00	415,888.00
194	000975	银泰黄金	2023年6月13日 -2023年7月11日	11.70	35,200.00	411,840.00
195	000960	锡业股份	2023年6月8日 -2023年7月6日	15.55	25,900.00	402,745.00
196	600392	盛和资源	2023年6月26日 -2023年7月10日	12.87	31,200.00	401,544.00
197	000960	锡业股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	15.55	25,600.00	398,080.00

198	000630	铜陵有色	2023年6月20日 -2023年7月4日	2.89	137,000.00	395,930.00
199	000630	铜陵有色	2023年6月20日 -2023年7月4日	2.89	137,000.00	395,930.00
200	600489	中金黄金	2023年6月20日 -2023年7月4日	10.33	38,000.00	392,540.00
201	600489	中金黄金	2023年6月26日 -2023年7月10日	10.33	37,900.00	391,507.00
202	300618	寒锐钴业	2023年6月27日 -2023年7月11日	32.41	12,000.00	388,920.00
203	000831	中国稀土	2023年6月27日 -2023年7月11日	29.60	13,100.00	387,760.00
204	000629	钒钛股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	3.91	98,800.00	386,308.00
205	600338	西藏珠峰	2023年6月29日 -2023年7月13日	18.26	21,000.00	383,460.00
206	000629	钒钛股份	2023年6月21日 -2023年7月19日	3.91	96,900.00	378,879.00
207	601168	西部矿业	2023年6月20日 -2023年7月4日	10.51	36,000.00	378,360.00
208	002532	天山铝业	2023年6月12日 -2023年7月10日	5.99	63,000.00	377,370.00
209	600547	山东黄金	2023年6月20日 -2023年7月4日	23.48	16,000.00	375,680.00
210	601677	明泰铝业	2023年6月30日 -2023年7月14日	13.88	27,000.00	374,760.00
211	000933	神火股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	13.00	28,700.00	373,100.00
212	600456	宝钛股份	2023年6月29日 -2023年7月13日	33.84	11,000.00	372,240.00
213	600111	北方稀土	2023年6月26日 -2023年7月3日	23.98	15,400.00	369,292.00
214	603876	鼎胜新材	2023年6月26日 -2023年7月10日	19.19	19,000.00	364,610.00
215	600259	广晟有色	2023年6月21日 -2023年7月5日	36.14	10,000.00	361,400.00
216	600673	东阳光	2023年6月21日 -2023年7月5日	7.21	50,100.00	361,221.00
217	002192	融捷股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	66.83	5,400.00	360,882.00
218	600673	东阳光	2023年6月19日 -2023年7月3日	7.21	50,000.00	360,500.00
219	600392	盛和资源	2023年6月20日 -2023年7月4日	12.87	28,000.00	360,360.00

220	002532	天山铝业	2023年6月26日 -2023年7月10日	5.99	59,700.00	357,603.00
221	002203	海亮股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	12.01	29,700.00	356,697.00
222	000762	西藏矿业	2023年6月20日 -2023年7月4日	29.63	12,000.00	355,560.00
223	600338	西藏珠峰	2023年6月13日 -2023年7月11日	18.26	19,200.00	350,592.00
224	600673	东阳光	2023年6月19日 -2023年7月3日	7.21	48,000.00	346,080.00
225	600673	东阳光	2023年6月19日 -2023年7月3日	7.21	48,000.00	346,080.00
226	600547	山东黄金	2023年6月8日 -2023年7月6日	23.48	14,600.00	342,808.00
227	000060	中金岭南	2023年6月21日 -2023年7月5日	4.75	72,000.00	342,000.00
228	002532	天山铝业	2023年6月20日 -2023年7月4日	5.99	57,000.00	341,430.00
229	000762	西藏矿业	2023年6月13日 -2023年7月11日	29.63	11,500.00	340,745.00
230	002978	安宁股份	2023年6月29日 -2023年7月13日	32.11	10,600.00	340,366.00
231	000629	钒钛股份	2023年6月29日 -2023年7月27日	3.91	87,000.00	340,170.00
232	600673	东阳光	2023年6月28日 -2023年7月12日	7.21	47,000.00	338,870.00
233	600392	盛和资源	2023年6月9日 -2023年7月7日	12.87	26,200.00	337,194.00
234	601958	金钼股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	11.15	30,000.00	334,500.00
235	000970	中科三环	2023年6月27日 -2023年7月4日	12.82	26,000.00	333,320.00
236	002532	天山铝业	2023年6月13日 -2023年7月11日	5.99	55,100.00	330,049.00
237	000831	中国稀土	2023年6月20日 -2023年7月4日	29.60	11,100.00	328,560.00
238	000970	中科三环	2023年6月13日 -2023年7月11日	12.82	25,600.00	328,192.00
239	600338	西藏珠峰	2023年6月28日 -2023年7月5日	18.26	17,800.00	325,028.00
240	300618	寒锐钴业	2023年6月28日 -2023年7月12日	32.41	10,000.00	324,100.00
241	600338	西藏珠峰	2023年6月30日 -2023年7月14日	18.26	17,600.00	321,376.00

242	002978	安宁股份	2023年6月26日 -2023年7月24日	32.11	10,000.00	321,100.00
243	000060	中金岭南	2023年6月13日 -2023年7月11日	4.75	66,900.00	317,775.00
244	600111	北方稀土	2023年6月13日 -2023年7月11日	23.98	13,200.00	316,536.00
245	600392	盛和资源	2023年6月15日 -2023年7月13日	12.87	24,000.00	308,880.00
246	600489	中金黄金	2023年6月16日 -2023年7月14日	10.33	29,600.00	305,768.00
247	300748	金力永磁	2023年6月13日 -2023年7月11日	29.92	10,200.00	305,184.00
248	601677	明泰铝业	2023年6月13日 -2023年7月11日	13.88	21,900.00	303,972.00
249	600489	中金黄金	2023年6月13日 -2023年7月11日	10.33	29,400.00	303,702.00
250	000688	国城矿业	2023年6月9日 -2023年7月7日	15.17	20,000.00	303,400.00
251	600338	西藏珠峰	2023年6月29日 -2023年7月13日	18.26	16,600.00	303,116.00
252	000831	中国稀土	2023年6月26日 -2023年7月3日	29.60	10,200.00	301,920.00
253	000629	钒钛股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	3.91	75,800.00	296,378.00
254	600673	东阳光	2023年6月13日 -2023年7月11日	7.21	40,400.00	291,284.00
255	603876	鼎胜新材	2023年6月28日 -2023年7月12日	19.19	15,000.00	287,850.00
256	002738	中矿资源	2023年6月29日 -2023年7月13日	50.94	5,600.00	285,264.00
257	601702	华峰铝业	2023年6月21日 -2023年7月5日	13.68	20,800.00	284,544.00
258	600338	西藏珠峰	2023年6月29日 -2023年7月13日	18.26	15,500.00	283,030.00
259	002128	电投能源	2023年6月13日 -2023年7月11日	13.22	21,000.00	277,620.00
260	603993	洛阳钼业	2023年6月8日 -2023年7月6日	5.33	51,900.00	276,627.00
261	000060	中金岭南	2023年6月12日 -2023年7月10日	4.75	58,100.00	275,975.00
262	601958	金钼股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	11.15	24,700.00	275,405.00
263	600547	山东黄金	2023年6月19日 -2023年7月17日	23.48	11,700.00	274,716.00

264	601702	华峰铝业	2023年6月21日 -2023年7月5日	13.68	20,000.00	273,600.00
265	601702	华峰铝业	2023年6月21日 -2023年7月5日	13.68	20,000.00	273,600.00
266	002466	天齐锂业	2023年6月9日 -2023年7月7日	69.91	3,900.00	272,649.00
267	600497	驰宏锌锗	2023年6月12日 -2023年7月10日	5.02	54,000.00	271,080.00
268	600456	宝钛股份	2023年6月30日 -2023年7月14日	33.84	8,000.00	270,720.00
269	002532	天山铝业	2023年6月20日 -2023年7月4日	5.99	45,000.00	269,550.00
270	600988	赤峰黄金	2023年6月20日 -2023年7月4日	13.46	20,000.00	269,200.00
271	000975	银泰黄金	2023年6月20日 -2023年7月18日	11.70	23,000.00	269,100.00
272	603876	鼎胜新材	2023年6月26日 -2023年7月10日	19.19	14,000.00	268,660.00
273	600338	西藏珠峰	2023年6月30日 -2023年7月14日	18.26	14,400.00	262,944.00
274	002155	湖南黄金	2023年6月13日 -2023年7月11日	12.20	21,400.00	261,080.00
275	601702	华峰铝业	2023年6月21日 -2023年7月19日	13.68	19,000.00	259,920.00
276	601702	华峰铝业	2023年6月21日 -2023年7月19日	13.68	19,000.00	259,920.00
277	000630	铜陵有色	2023年6月12日 -2023年7月10日	2.89	89,300.00	258,077.00
278	600673	东阳光	2023年6月9日 -2023年7月7日	7.21	35,600.00	256,676.00
279	600259	广晟有色	2023年6月13日 -2023年7月11日	36.14	7,100.00	256,594.00
280	600338	西藏珠峰	2023年6月20日 -2023年7月4日	18.26	14,000.00	255,640.00
281	000807	云铝股份	2023年6月29日 -2023年7月13日	12.73	20,000.00	254,600.00
282	601702	华峰铝业	2023年6月29日 -2023年7月13日	13.68	18,500.00	253,080.00
283	000975	银泰黄金	2023年6月12日 -2023年7月10日	11.70	21,600.00	252,720.00
284	600338	西藏珠峰	2023年6月26日 -2023年7月3日	18.26	13,800.00	251,988.00
285	002466	天齐锂业	2023年6月13日 -2023年7月11日	69.91	3,600.00	251,676.00

286	600392	盛和资源	2023年6月9日 -2023年7月7日	12.87	19,400.00	249,678.00
287	601677	明泰铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	13.88	17,900.00	248,452.00
288	000933	神火股份	2023年6月21日 -2023年7月5日	13.00	19,000.00	247,000.00
289	002155	湖南黄金	2023年6月19日 -2023年7月3日	12.20	20,000.00	244,000.00
290	002203	海亮股份	2023年6月27日 -2023年7月11日	12.01	20,000.00	240,200.00
291	002203	海亮股份	2023年6月27日 -2023年7月11日	12.01	20,000.00	240,200.00
292	002203	海亮股份	2023年6月20日 -2023年7月4日	12.01	20,000.00	240,200.00
293	600456	宝钛股份	2023年6月29日 -2023年7月13日	33.84	7,000.00	236,880.00
294	600456	宝钛股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	33.84	7,000.00	236,880.00
295	000688	国城矿业	2023年6月27日 -2023年7月11日	15.17	15,500.00	235,135.00
296	600456	宝钛股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	33.84	6,900.00	233,496.00
297	002532	天山铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	5.99	38,600.00	231,214.00
298	600673	东阳光	2023年6月19日 -2023年7月3日	7.21	32,000.00	230,720.00
299	603876	鼎胜新材	2023年6月13日 -2023年7月11日	19.19	11,900.00	228,361.00
300	002203	海亮股份	2023年6月26日 -2023年7月24日	12.01	19,000.00	228,190.00
301	000688	国城矿业	2023年6月19日 -2023年7月3日	15.17	14,700.00	222,999.00
302	000878	云南铜业	2023年6月8日 -2023年7月6日	11.05	20,000.00	221,000.00
303	603876	鼎胜新材	2023年6月26日 -2023年7月10日	19.19	11,400.00	218,766.00
304	000933	神火股份	2023年6月9日 -2023年7月7日	13.00	16,700.00	217,100.00
305	002466	天齐锂业	2023年6月30日 -2023年7月14日	69.91	3,100.00	216,721.00
306	000933	神火股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	13.00	16,400.00	213,200.00
307	600673	东阳光	2023年6月30日 -2023年7月14日	7.21	29,000.00	209,090.00

308	600673	东阳光	2023年6月20日 -2023年7月4日	7.21	29,000.00	209,090.00
309	601212	白银有色	2023年6月13日 -2023年7月11日	2.72	74,900.00	203,728.00
310	600259	广晟有色	2023年6月13日 -2023年7月11日	36.14	5,600.00	202,384.00
311	000960	锡业股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	15.55	13,000.00	202,150.00
312	601168	西部矿业	2023年6月21日 -2023年7月5日	10.51	19,000.00	199,690.00
313	002497	雅化集团	2023年6月26日 -2023年7月10日	17.78	11,200.00	199,136.00
314	600392	盛和资源	2023年6月6日 -2023年7月4日	12.87	15,400.00	198,198.00
315	002203	海亮股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	12.01	16,400.00	196,964.00
316	300618	寒锐钴业	2023年6月13日 -2023年7月11日	32.41	6,000.00	194,460.00
317	601677	明泰铝业	2023年6月29日 -2023年7月13日	13.88	14,000.00	194,320.00
318	603876	鼎胜新材	2023年6月26日 -2023年7月10日	19.19	10,000.00	191,900.00
319	000060	中金岭南	2023年6月20日 -2023年7月4日	4.75	40,000.00	190,000.00
320	600219	南山铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	3.02	59,600.00	179,992.00
321	601212	白银有色	2023年6月13日 -2023年7月11日	2.72	65,600.00	178,432.00
322	600392	盛和资源	2023年6月26日 -2023年7月10日	12.87	13,800.00	177,606.00
323	000831	中国稀土	2023年6月20日 -2023年7月4日	29.60	6,000.00	177,600.00
324	002192	融捷股份	2023年6月13日 -2023年7月11日	66.83	2,600.00	173,758.00
325	600362	江西铜业	2023年6月20日 -2023年7月4日	18.98	9,000.00	170,820.00
326	600219	南山铝业	2023年6月13日 -2023年7月11日	3.02	56,300.00	170,026.00
327	600456	宝钛股份	2023年6月20日 -2023年7月4日	33.84	5,000.00	169,200.00
328	600219	南山铝业	2023年6月26日 -2023年7月10日	3.02	55,000.00	166,100.00
329	603876	鼎胜新材	2023年6月21日 -2023年7月5日	19.19	8,500.00	163,115.00

330	002532	天山铝业	2023年6月20日 -2023年7月4日	5.99	27,000.00	161,730.00
331	000629	钒钛股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	3.91	41,300.00	161,483.00
332	000762	西藏矿业	2023年6月13日 -2023年7月11日	29.63	5,400.00	160,002.00
333	002756	永兴材料	2023年6月19日 -2023年7月3日	62.61	2,500.00	156,525.00
334	002738	中矿资源	2023年6月26日 -2023年7月10日	50.94	3,000.00	152,820.00
335	601677	明泰铝业	2023年6月28日 -2023年7月12日	13.88	11,000.00	152,680.00
336	000688	国城矿业	2023年6月19日 -2023年7月3日	15.17	10,000.00	151,700.00
337	000970	中科三环	2023年6月26日 -2023年7月10日	12.82	11,800.00	151,276.00
338	600219	南山铝业	2023年6月30日 -2023年7月14日	3.02	50,000.00	151,000.00
339	600497	驰宏锌锗	2023年6月19日 -2023年7月3日	5.02	30,000.00	150,600.00
340	301219	腾远钴业	2023年6月26日 -2023年7月10日	37.36	4,000.00	149,440.00
341	301219	腾远钴业	2023年6月26日 -2023年7月10日	37.36	4,000.00	149,440.00
342	301219	腾远钴业	2023年6月26日 -2023年7月10日	37.36	4,000.00	149,440.00
343	301219	腾远钴业	2023年6月26日 -2023年7月10日	37.36	4,000.00	149,440.00
344	601168	西部矿业	2023年6月19日 -2023年7月3日	10.51	14,000.00	147,140.00
345	000933	神火股份	2023年6月26日 -2023年7月10日	13.00	11,100.00	144,300.00
346	600673	东阳光	2023年6月21日 -2023年7月5日	7.21	20,000.00	144,200.00
347	600219	南山铝业	2023年6月30日 -2023年7月14日	3.02	47,000.00	141,940.00
348	600673	东阳光	2023年6月19日 -2023年7月3日	7.21	19,000.00	136,990.00
349	300748	金力永磁	2023年6月19日 -2023年7月3日	29.92	4,500.00	134,640.00
350	301219	腾远钴业	2023年6月26日 -2023年7月10日	37.36	3,600.00	134,496.00
351	600219	南山铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	3.02	44,000.00	132,880.00

352	002532	天山铝业	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	5.99	22,000.00	131,780.00
353	002532	天山铝业	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	5.99	21,000.00	125,790.00
354	603876	鼎胜新材	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	19.19	6,500.00	124,735.00
355	000960	锡业股份	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	15.55	8,000.00	124,400.00
356	002203	海亮股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	12.01	10,000.00	120,100.00
357	000688	国城矿业	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	15.17	7,700.00	116,809.00
358	600673	东阳光	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	7.21	16,000.00	115,360.00
359	000960	锡业股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	15.55	7,400.00	115,070.00
360	301219	腾远钴业	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	37.36	3,000.00	112,080.00
361	000060	中金岭南	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	4.75	23,000.00	109,250.00
362	600219	南山铝业	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	3.02	35,000.00	105,700.00
363	600111	北方稀土	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 3 日	23.98	4,400.00	105,512.00
364	601702	华峰铝业	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	13.68	7,700.00	105,336.00
365	600456	宝钛股份	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	33.84	3,000.00	101,520.00
366	600456	宝钛股份	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	33.84	3,000.00	101,520.00
367	000060	中金岭南	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	4.75	21,000.00	99,750.00
368	002532	天山铝业	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	5.99	16,000.00	95,840.00
369	002532	天山铝业	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	5.99	16,000.00	95,840.00
370	002532	天山铝业	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	5.99	16,000.00	95,840.00
371	000629	钒钛股份	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	3.91	24,400.00	95,404.00
372	000630	铜陵有色	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	2.89	33,000.00	95,370.00
373	000630	铜陵有色	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	2.89	33,000.00	95,370.00

374	000630	铜陵有色	2023年6月28日 -2023年7月5日	2.89	32,700.00	94,503.00
375	000960	锡业股份	2023年6月29日 -2023年7月13日	15.55	6,000.00	93,300.00
376	000060	中金岭南	2023年6月26日 -2023年7月10日	4.75	19,000.00	90,250.00
377	600673	东阳光	2023年6月27日 -2023年7月11日	7.21	12,000.00	86,520.00
378	002466	天齐锂业	2023年6月28日 -2023年7月5日	69.91	1,200.00	83,892.00
379	002203	海亮股份	2023年6月21日 -2023年7月5日	12.01	6,800.00	81,668.00
380	600673	东阳光	2023年6月29日 -2023年7月13日	7.21	11,000.00	79,310.00
381	600111	北方稀土	2023年6月19日 -2023年7月3日	23.98	3,300.00	79,134.00
382	600219	南山铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	3.02	26,000.00	78,520.00
383	002203	海亮股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	12.01	6,500.00	78,065.00
384	000960	锡业股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	15.55	5,000.00	77,750.00
385	601168	西部矿业	2023年6月26日 -2023年7月10日	10.51	7,000.00	73,570.00
386	600219	南山铝业	2023年6月30日 -2023年7月14日	3.02	23,000.00	69,460.00
387	601677	明泰铝业	2023年6月29日 -2023年7月13日	13.88	5,000.00	69,400.00
388	601958	金钼股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	11.15	6,100.00	68,015.00
389	600456	宝钛股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	33.84	2,000.00	67,680.00
390	000933	神火股份	2023年6月29日 -2023年7月13日	13.00	5,200.00	67,600.00
391	600111	北方稀土	2023年6月26日 -2023年7月10日	23.98	2,800.00	67,144.00
392	600497	驰宏锌锗	2023年6月19日 -2023年7月3日	5.02	13,200.00	66,264.00
393	002532	天山铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	5.99	11,000.00	65,890.00
394	002532	天山铝业	2023年6月26日 -2023年7月3日	5.99	11,000.00	65,890.00
395	000970	中科三环	2023年6月26日 -2023年7月10日	12.82	5,100.00	65,382.00

396	000960	锡业股份	2023年6月30日 -2023年7月14日	15.55	4,000.00	62,200.00
397	600497	驰宏锌锗	2023年6月20日 -2023年7月4日	5.02	12,000.00	60,240.00
398	600111	北方稀土	2023年6月26日 -2023年7月10日	23.98	2,500.00	59,950.00
399	002532	天山铝业	2023年6月26日 -2023年7月10日	5.99	10,000.00	59,900.00
400	002532	天山铝业	2023年6月26日 -2023年7月10日	5.99	10,000.00	59,900.00
401	002497	雅化集团	2023年6月28日 -2023年7月12日	17.78	3,300.00	58,674.00
402	000933	神火股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	13.00	4,400.00	57,200.00
403	000060	中金岭南	2023年6月30日 -2023年7月14日	4.75	12,000.00	57,000.00
404	601677	明泰铝业	2023年6月29日 -2023年7月13日	13.88	4,000.00	55,520.00
405	601677	明泰铝业	2023年6月30日 -2023年7月14日	13.88	4,000.00	55,520.00
406	601677	明泰铝业	2023年6月27日 -2023年7月11日	13.88	4,000.00	55,520.00
407	300748	金力永磁	2023年6月26日 -2023年7月10日	29.92	1,800.00	53,856.00
408	600497	驰宏锌锗	2023年6月26日 -2023年7月10日	5.02	10,400.00	52,208.00
409	600338	西藏珠峰	2023年6月19日 -2023年7月3日	18.26	2,800.00	51,128.00
410	002738	中矿资源	2023年6月21日 -2023年7月5日	50.94	1,000.00	50,940.00
411	600392	盛和资源	2023年6月27日 -2023年7月4日	12.87	3,700.00	47,619.00
412	000970	中科三环	2023年6月27日 -2023年7月11日	12.82	3,400.00	43,588.00
413	002532	天山铝业	2023年6月19日 -2023年7月3日	5.99	7,000.00	41,930.00
414	601677	明泰铝业	2023年6月29日 -2023年7月13日	13.88	3,000.00	41,640.00
415	300618	寒锐钴业	2023年6月20日 -2023年7月4日	32.41	1,200.00	38,892.00
416	000831	中国稀土	2023年6月27日 -2023年7月11日	29.60	1,300.00	38,480.00
417	600259	广晟有色	2023年6月19日 -2023年7月3日	36.14	1,000.00	36,140.00

418	600392	盛和资源	2023年6月27日 -2023年7月11日	12.87	2,800.00	36,036.00
419	600111	北方稀土	2023年6月29日 -2023年7月13日	23.98	1,400.00	33,572.00
420	600338	西藏珠峰	2023年6月20日 -2023年7月4日	18.26	1,800.00	32,868.00
421	000688	国城矿业	2023年6月27日 -2023年7月11日	15.17	2,100.00	31,857.00
422	000807	云铝股份	2023年6月19日 -2023年7月3日	12.73	2,400.00	30,552.00
423	002532	天山铝业	2023年6月20日 -2023年7月4日	5.99	5,000.00	29,950.00
424	002532	天山铝业	2023年6月26日 -2023年7月3日	5.99	5,000.00	29,950.00
425	600673	东阳光	2023年6月27日 -2023年7月4日	7.21	4,000.00	28,840.00
426	600988	赤峰黄金	2023年6月29日 -2023年7月13日	13.46	2,100.00	28,266.00
427	601677	明泰铝业	2023年6月20日 -2023年7月4日	13.88	2,000.00	27,760.00
428	002155	湖南黄金	2023年6月19日 -2023年7月3日	12.20	2,200.00	26,840.00
429	000933	神火股份	2023年6月30日 -2023年7月14日	13.00	2,000.00	26,000.00
430	000688	国城矿业	2023年6月21日 -2023年7月5日	15.17	1,700.00	25,789.00
431	002532	天山铝业	2023年6月29日 -2023年7月13日	5.99	4,000.00	23,960.00
432	000933	神火股份	2023年6月28日 -2023年7月5日	13.00	1,600.00	20,800.00
433	600362	江西铜业	2023年6月27日 -2023年7月11日	18.98	1,000.00	18,980.00
434	600362	江西铜业	2023年6月26日 -2023年7月10日	18.98	1,000.00	18,980.00
435	000933	神火股份	2023年6月30日 -2023年7月14日	13.00	1,400.00	18,200.00
436	600219	南山铝业	2023年6月27日 -2023年7月11日	3.02	6,000.00	18,120.00
437	002532	天山铝业	2023年6月30日 -2023年7月14日	5.99	3,000.00	17,970.00
438	002532	天山铝业	2023年6月30日 -2023年7月14日	5.99	3,000.00	17,970.00
439	002532	天山铝业	2023年6月30日 -2023年7月14日	5.99	3,000.00	17,970.00

440	600392	盛和资源	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 3 日	12.87	1,300.00	16,731.00
441	000933	神火股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	13.00	1,200.00	15,600.00
442	000933	神火股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	13.00	1,200.00	15,600.00
443	601958	金钼股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	11.15	1,300.00	14,495.00
444	600673	东阳光	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	7.21	2,000.00	14,420.00
445	601677	明泰铝业	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	13.88	1,000.00	13,880.00
446	600392	盛和资源	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	12.87	1,000.00	12,870.00
447	600392	盛和资源	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	12.87	1,000.00	12,870.00
448	002532	天山铝业	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	5.99	2,000.00	11,980.00
449	002532	天山铝业	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 3 日	5.99	2,000.00	11,980.00
450	002532	天山铝业	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	5.99	2,000.00	11,980.00
451	600497	驰宏锌锗	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 3 日	5.02	1,900.00	9,538.00
452	002532	天山铝业	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	5.99	1,000.00	5,990.00
453	600219	南山铝业	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	3.02	1,000.00	3,020.00
合计	-	-	-	-	16,661,100.00	263,240,592.00

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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金属被动式股票指数基金，运用以完全复制为目标的指数化投资方法，通过严格的投资约束和数量化风险控制手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差不超过 0.35%，实现对国证有色金属行业指数的有效跟踪。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处

的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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 6.4.12。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。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%。

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

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

6.4.13.4 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、债券投资、存出保证金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 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	129,113,828.16	-	-	-	129,113,828.16
存出保证金	56,079.12	-	-	-	56,079.12
交易性金融资产	-	-	-	1,562,078,976.89	1,562,078,976.89
应收股利	-	-	-	1,100,597.96	1,100,597.96
应收申购款	632.17	-	-	3,192,423.43	3,193,055.60
其他资产	-	-	-	113,632.00	113,632.00
资产总计	129,170,539.45	-	-	1,566,485,630.28	1,695,656,169.73
负债					
应付清算款	-	-	-	9,980,705.67	9,980,705.67
应付赎回款	-	-	-	5,513,398.66	5,513,398.66
应付管理人报酬	-	-	-	1,392,542.37	1,392,542.37
应付托管费	-	-	-	306,359.33	306,359.33
应付销售服务费	-	-	-	5,955.26	5,955.26
应交税费	-	-	-	17,212.83	17,212.83
其他负债	-	-	-	755,278.49	755,278.49

负债总计	-	-	-	17,971,452.61	17,971,452.61
利率敏感度缺口	129,170,539.45	-	-	1,548,514,177.67	1,677,684,717.12
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	77,785,031.50	-	-	-	77,785,031.50
结算备付金	304,923.25	-	-	-	304,923.25
存出保证金	94,835.97	-	-	-	94,835.97
交易性金融资产	30,922,552.64	-	-	1,696,400,571.75	1,727,323,124.39
应收清算款	-	-	-	45,434,775.36	45,434,775.36
应收股利	-	-	-	10,300.00	10,300.00
应收申购款	1,120.80	-	-	2,172,442.00	2,173,562.80
其他资产	-	-	-	148,105.49	148,105.49
资产总计	109,108,464.16	-	-	1,744,166,194.60	1,853,274,658.76
负债					
应付清算款	-	-	-	38,419,957.38	38,419,957.38
应付赎回款	-	-	-	3,717,669.04	3,717,669.04
应付管理人报酬	-	-	-	1,597,256.06	1,597,256.06
应付托管费	-	-	-	351,396.34	351,396.34
应付销售服务费	-	-	-	8,792.61	8,792.61
应交税费	-	-	-	15,832.78	15,832.78
其他负债	-	-	-	807,856.56	807,856.56
负债总计	-	-	-	44,918,760.77	44,918,760.77
利率敏感度缺口	109,108,464.16	-	-	1,699,247,433.83	1,808,355,897.99

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日: 1.71%), 因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022 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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于上市交易的证券, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险, 严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 包括 VaR(Value at Risk)指标等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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 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	1,562,078,976.89	93.11	1,696,400,571.75	93.81
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	1,562,078,97 6.89	93.11	1,696,400,571 .75	93.81
----	----------------------	-------	----------------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 7,997	增加约 8,678
	业绩比较基准下降 5%	减少约 7,997	减少约 8,678

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,560,824,981.81	1,695,056,393.53
第二层次	255,956.94	30,922,552.64
第三层次	998,038.14	1,344,178.22
合计	1,562,078,976.89	1,727,323,124.39

6.4.14.2.2 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,562,078,976.89	92.12
	其中：股票	1,562,078,976.89	92.12
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	129,113,828.16	7.61
8	其他各项资产	4,463,364.68	0.26
9	合计	1,695,656,169.73	100.00

注：报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不

存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 263,240,592.00 元，占基金资产净值比例为 15.69%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	580,366,056.77	34.59
C	制造业	961,043,576.10	57.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,999,520.00	0.18
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	16,415,828.94	0.98
	合计	1,560,824,981.81	93.03

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例
----	------	------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,051,124.72	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	30,441.28	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	80,548.12	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	1,253,995.08	0.07

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 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	19,288,919	219,315,009.03	13.07
2	002466	天齐锂业	1,843,688	128,892,228.08	7.68
3	002460	赣锋锂业	1,592,859	97,100,684.64	5.79
4	603799	华友钴业	2,073,107	95,176,342.37	5.67
5	600111	北方稀土	3,359,100	80,551,218.00	4.80
6	601600	中国铝业	10,404,328	57,119,760.72	3.40

7	603993	洛阳钼业	9,352,985	49,851,410.05	2.97
8	600547	山东黄金	2,108,642	49,510,914.16	2.95
9	002738	中矿资源	938,044	47,783,961.36	2.85
10	600489	中金黄金	3,506,810	36,225,347.30	2.16
11	000807	云铝股份	2,681,328	34,133,305.44	2.03
12	000831	中国稀土	945,139	27,976,114.40	1.67
13	600988	赤峰黄金	2,072,243	27,892,390.78	1.66
14	000629	钒钛股份	7,083,114	27,694,975.74	1.65
15	000975	银泰黄金	2,361,917	27,634,428.90	1.65
16	000960	锡业股份	1,686,686	26,227,967.30	1.56
17	000630	铜陵有色	8,922,366	25,785,637.74	1.54
18	000933	神火股份	1,971,427	25,628,551.00	1.53
19	002756	永兴材料	394,530	24,701,523.30	1.47
20	600219	南山铝业	7,951,761	24,014,318.22	1.43
21	002497	雅化集团	1,314,926	23,379,384.28	1.39
22	002192	融捷股份	348,574	23,295,200.42	1.39
23	601168	西部矿业	2,213,624	23,265,188.24	1.39
24	600392	盛和资源	1,726,666	22,222,191.42	1.32
25	600362	江西铜业	1,163,617	22,085,450.66	1.32
26	600497	驰宏锌锗	4,203,077	21,099,446.54	1.26
27	000878	云南铜业	1,824,479	20,160,492.95	1.20
28	000970	中科三环	1,464,430	18,773,992.60	1.12
29	002203	海亮股份	1,424,430	17,107,404.30	1.02
30	600338	西藏珠峰	919,327	16,786,911.02	1.00
31	601677	明泰铝业	1,187,174	16,477,975.12	0.98
32	600673	东阳光	2,276,814	16,415,828.94	0.98
33	000762	西藏矿业	550,306	16,305,566.78	0.97
34	002532	天山铝业	2,644,435	15,840,165.65	0.94
35	000060	中金岭南	3,207,910	15,237,572.50	0.91
36	300748	金力永磁	487,342	14,581,272.64	0.87
37	002128	电投能源	1,009,400	13,344,268.00	0.80
38	601958	金钼股份	1,185,586	13,219,283.90	0.79
39	002155	湖南黄金	1,027,500	12,535,500.00	0.75
40	000426	兴业银锡	1,337,100	11,873,448.00	0.71
41	600456	宝钛股份	333,157	11,274,032.88	0.67
42	603876	鼎胜新材	570,880	10,955,187.20	0.65
43	601212	白银有色	3,593,178	9,773,444.16	0.58
44	600259	广晟有色	267,245	9,658,234.30	0.58
45	300618	寒锐钴业	288,199	9,340,529.59	0.56
46	601702	华峰铝业	419,400	5,737,392.00	0.34
47	000688	国城矿业	369,048	5,598,458.16	0.33
48	301219	腾远钴业	142,144	5,310,499.84	0.32
49	600361	华联综超	624,900	2,999,520.00	0.18
50	002978	安宁股份	92,029	2,955,051.19	0.18

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
2	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.01
3	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
4	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
5	301358	湖南裕能	1,840	78,917.60	0.00
6	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
7	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
8	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
9	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
10	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
11	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
12	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
13	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
14	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
15	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
16	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
17	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
18	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
19	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
20	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
21	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
22	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
23	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
24	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
25	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
26	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
27	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
28	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
29	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
30	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
31	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
32	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
33	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
34	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
35	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
36	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
37	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
38	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00

39	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
40	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
41	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
42	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
43	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
44	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
45	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
46	001367	海森药业	55	2,171.40	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	61,363,894.54	3.39
2	002497	雅化集团	31,732,226.27	1.75
3	002756	永兴材料	30,602,381.50	1.69
4	002460	赣锋锂业	24,673,385.58	1.36
5	603799	华友钴业	20,900,735.27	1.16
6	002128	电投能源	17,395,179.00	0.96
7	600111	北方稀土	15,750,999.00	0.87
8	002738	中矿资源	15,700,590.58	0.87
9	000426	兴业银锡	15,170,676.50	0.84
10	603876	鼎胜新材	13,077,334.20	0.72
11	002532	天山铝业	9,027,829.75	0.50
12	000629	钒钛股份	9,008,767.14	0.50
13	000960	锡业股份	6,658,203.00	0.37
14	601899	紫金矿业	6,220,926.00	0.34
15	002192	融捷股份	5,355,226.00	0.30
16	600338	西藏珠峰	5,142,248.00	0.28
17	000762	西藏矿业	5,013,519.00	0.28
18	000878	云南铜业	4,610,950.00	0.25
19	000807	云铝股份	4,463,921.00	0.25
20	600361	华联综超	3,966,094.00	0.22

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。

7.4.2 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	002340	格林美	48,837,540.00	2.70
2	601899	紫金矿业	38,409,676.00	2.12
3	002460	赣锋锂业	27,865,111.80	1.54
4	600549	厦门钨业	23,122,825.43	1.28
5	002056	横店东磁	19,935,162.66	1.10
6	600111	北方稀土	15,632,033.00	0.86
7	002466	天齐锂业	13,962,651.09	0.77
8	603799	华友钴业	12,023,627.00	0.66
9	603993	洛阳钼业	11,630,918.00	0.64
10	600206	有研新材	11,054,466.00	0.61
11	600547	山东黄金	10,827,942.10	0.60
12	600219	南山铝业	10,715,791.75	0.59
13	688388	嘉元科技	9,958,981.29	0.55
14	601600	中国铝业	9,809,469.00	0.54
15	002171	楚江新材	9,637,366.03	0.53
16	605376	博迁新材	9,599,326.00	0.53
17	002237	恒邦股份	9,339,535.60	0.52
18	600489	中金黄金	7,803,282.00	0.43
19	600295	鄂尔多斯	7,364,274.88	0.41
20	002497	雅化集团	7,193,364.00	0.40

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。

7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	367,196,705.21
卖出股票的收入（成交）总额	476,411,807.27

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“赣锋锂业”公告自身或分支机构违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

赣锋锂业因涉嫌 A 股某上市公司股票二级市场内幕交易；对外投资中未及时履行信息披露义务；对外收购事项收购完成后未及时披露有关交付或者过户事宜等问题，受到深交所监管关注、江西证监局罚款、没收违法所得等处罚。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。

本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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

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	56,079.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	1,100,597.96
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,193,055.60
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	113,632.00
9	合计	4,463,364.68

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	002466	天齐锂业	31,291,716.00	1.87	转融通证券 出借业务的 股票
2	603799	华友钴业	28,399,926.00	1.69	转融通证券 出借业务的 股票
3	600111	北方稀土	20,442,950.00	1.22	转融通证券 出借业务的 股票
4	002460	赣锋锂业	19,763,232.00	1.18	转融通证券 出借业务的 股票
5	002738	中矿资源	14,263,200.00	0.85	转融通证券 出借业务的 股票
6	601899	紫金矿业	8,442,225.00	0.50	转融通证券 出借业务的 股票
7	600489	中金黄金	7,440,699.00	0.44	转融通证券 出借业务的 股票
8	601600	中国铝业	5,087,583.00	0.30	转融通证券 出借业务的 股票
9	600547	山东黄金	2,540,536.00	0.15	转融通证券 出借业务的 股票

10	603993	洛阳钼业	1,315,444.00	0.08	转融通证券出借业务的股票
----	--------	------	--------------	------	--------------

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688249	晶合集成	133,734.30	0.01	新股锁定
2	688472	阿特斯	106,687.44	0.01	新股锁定
3	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.01	网下中签
4	301202	朗威股份	79,009.20	0.00	网下中签
5	301358	湖南裕能	78,917.60	0.00	新股锁定
6	301488	豪恩汽电	10,422.36	0.00	新股锁定

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰国证有色金属行业指数 A	371,720	3,584.87	42,299,946.79	3.17%	1,290,266,192.17	96.83%
国泰国证有色金属行业指数 C	7,049	4,854.54	9,738,440.24	28.46%	24,481,212.31	71.54%
合计	378,769	3,608.49	52,038,387.03	3.81%	1,314,747,404.48	96.19%

8.2 期末上市基金前十名持有人

国泰国证有色金属行业指数 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	杜心慧	2,000,000.00	4.47%
2	陈光明	1,747,984.00	3.91%
3	欧静虹	1,471,323.00	3.29%
4	谭锦祥	1,432,718.00	3.20%
5	陈丽芸	818,879.00	1.83%
6	梁一舟	787,576.00	1.76%
7	吴杰	730,950.00	1.63%
8	邓志光	600,000.00	1.34%
8	王亮	600,000.00	1.34%
10	石峰	443,176.00	0.99%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的名册编制。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰国证有色金属行业指数 A	62,772.48	0.00%
	国泰国证有色金属行业指数 C	76.61	0.00%
	合计	62,849.09	0.00%

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的情况

项目	份额级别	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	国泰国证有色金属行业指数 A	0
	国泰国证有色金属行业指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰国证有色金属行业指数 A	0
	国泰国证有色金属行业指数 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰国证有色金属行业指数 A	国泰国证有色金属行业指数 C
基金合同生效日（2021 年 1 月 1 日）基金份额总额	2,620,186,171.84	-
本报告期期初基金份额总额	1,407,120,135.96	41,647,412.06
本报告期基金总申购份额	346,459,931.85	73,723,497.04
减：本报告期基金总赎回份额	421,013,928.85	81,151,256.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,332,566,138.96	34,219,652.55

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本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

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	-	-	-	-	-
招商证券	2	227,437,604.63	27.33%	215,520.61	31.68%	-
国联证券	1	218,811,181.50	26.30%	157,830.68	23.20%	-
海通证券	2	113,316,543.32	13.62%	82,867.72	12.18%	-
长江证券	2	104,481,386.95	12.56%	97,304.71	14.30%	-
中信证券	2	101,116,645.42	12.15%	73,946.28	10.87%	-
东兴证券	1	36,882,329.17	4.43%	26,973.06	3.96%	-
中信建投	2	19,418,812.09	2.33%	18,084.84	2.66%	-
中泰证券	1	10,634,001.62	1.28%	7,776.74	1.14%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

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	
	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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	18,366,69 9.45	59.38%	-	-	-	-
中泰证券	12,561,92 8.12	40.62%	-	-	-	-

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金变更注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

11.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

基金托管人住所或办公场所。

11.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

二〇二三年八月三十日