

# 上证自然资源交易型开放式指数证券投资 基金

**2023 年中期报告**  
**2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	10
4.8 报告期内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 .....	10
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	10
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 .....	10
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>10</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	13
6.4 报表附注 .....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	34
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 .....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38

7.12 投资组合报告附注 .....	38
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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.....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>40</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件 .....	43
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>44</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录 .....	45
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	博时上证自然资源 ETF
场内简称	资源 ETF
基金主代码	510410
交易代码	510410
基金运作方式	交易型开放式指数基金
基金合同生效日	2012 年 4 月 10 日
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	331,258,387.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 11 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具，包括融资融券等。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即上证自然资源指数收益率。该指数属于价格指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险、高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证自然资源指数，

其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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）
本期已实现收益	10,402,893.62
本期利润	16,992,489.37
加权平均基金份额本期利润	0.0484
本期加权平均净值利润率	4.37%
本期基金份额净值增长率	4.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,421,393.04

期末可供分配基金份额利润	0.0767
期末基金资产净值	356,679,780.04
期末基金份额净值	1.0767
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	7.67%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.06%	0.89%	0.71%	0.91%	1.35%	-0.02%
过去三个月	-3.37%	1.05%	-5.35%	1.08%	1.98%	-0.03%
过去六个月	4.58%	1.06%	2.53%	1.09%	2.05%	-0.03%
过去一年	-6.14%	1.25%	-9.87%	1.27%	3.73%	-0.02%
过去三年	93.58%	1.75%	72.57%	1.77%	21.01%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.67%	1.71%	-5.94%	1.73%	13.61%	-0.02%

### 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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2023 年 6 月 30 日，博时基金公司共管理 355 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 14767 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 5220 亿元人民币，累计分红逾 1851 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王祥	基金经理	2016-11-02	-	10.9	王祥先生，学士。2006 年起先后在中粮期货、工商银行总行工作。2015 年加入博时基金管理有限公司。曾任基金经理助理。现任博时黄金交易型开放式证券投资基金（2016 年 11 月 2 日一至今）、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金（2016 年 11 月 2 日一至今）、博时黄金交易型开放式证券投资基金联接基金（2016 年 11 月 2 日一至今）、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金（2016 年 11 月 2 日一至今）、博时中证光伏产业指数证券投资基金（2022 年 8 月 16 日一至今）、博时中证疫苗与生物技术交易型开放式指数证券投资基金（2022 年 11 月 8 日一至今）、博时中证农业主题指数型发起式证券投资基金（2022 年 12 月 13 日一至今）、博时中证有色金属矿业主题指数证券投资基金（2023 年 5 月 16 日一至今）的基金经理。



王萌	基金经理助理	2023-03-06	-	6.9	王萌先生，博士。2016 年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。
----	--------	------------	---	-----	---

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 89 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，随着中国经济逐渐走出新冠疫情的阴霾，各行各业逐渐开启了修复模式，海内外投资者对资本市场的信心也得以回升，A 股市场走出完美开局。但进入二季度之后，在复苏动能弱于预期的现实的影响下，投资者迅速对全年经济复苏的乐观展望进行了调整。除了受新的技术红利影响的 AICG 方向迎来了显著的资金关注与充分期待之外，与实体经济联动更紧密的消费、周期、制造业等纷纷回吐了部分前期涨幅，尽管如此，万得全 A 指数上半年仍勉力走高 3.06%，打破了去年下半年以来的下行局面。

上证资源指数所代表的上游强周期行业追随经济复苏节奏的波动，在国内经济复苏不达预期的影响下，二季度 PPI 与 PMI 均转弱下行，拖累上游资源行业表现，上半年收涨 2.53%，按申万一级行业表现排序，指数半年回报处于前 40% 分位水平。

从细分行业来看，能源行业在全季表现疲软，成为整体资源品中最为明显的拖累，煤炭指数半年度收

跌近 7%，以锂矿为代表的能源金属指数也收跌接近 10%。由于国内产量、进口量有序增长，电厂进入消费淡季，而下游非电需求不足，煤价总体呈现弱势。特别是 5 月下旬以来，各环节库存持续攀升，各煤种年初以来累计跌幅约 30%。煤炭板块后续催化因素一方面或来自迎峰度夏煤价反弹预期，另一方面或来自“国企改革+中特估”概念下央国企估值修复预期。煤价双轨制背景下，板块低估值、高股息、高胜率的特性仍具备较强的投资价值。

石油石化板块上半年表现顽强，整体收涨 7.26%，已经连续两季对资源板块形成正面拉动。OPEC+减产给予油价底部支撑，但海外经济衰退担忧压制油价上行空间，预计近期油价中高位震荡运行。而从长历史周期来看，油价与油服企业业绩高度相关，油价中枢高位运行助力油服行业高景气。

资源品中的金属方向 2 季度整体收跌 6.3%，1 季度曾被热炒的小金属、贵金属板块双双下行。美国经济的超预期韧性以及美联储不断延展利率终点令市场情绪有所降温。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 06 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.0767 元，份额累计净值为 1.0767 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 4.58%，同期业绩基准增长率为 2.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 3 季度，资源品行业有望重拾升势。在基数效应退却后，美国名义 CPI 有可能重新走升，而进一步提升边际利率的空间已经有限。同时美国新屋开工与建筑许可等领先指标超预期抬升，新屋销售也量价齐升，边际需求在改善。叠加北半球夏季的能源需求高峰，上游资源品的市场关注度有望再次提高，并提供季节性的超额表现。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨

达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

---

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

---

## 6.1 资产负债表

会计主体：上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.3.1	8,512,461.95	4,800,907.60
结算备付金		43,735.62	-
存出保证金		1,861.93	5,180.05
交易性金融资产	6.4.3.2	348,481,943.75	370,347,699.65
其中：股票投资		348,481,943.75	370,347,699.65
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资	6.4.3.5	-	-
应收清算款		152,235.55	289,788.97
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	-	-
资产总计		357,192,238.80	375,443,576.27
<b>负债和净资产</b>			
	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		321.43	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		148,441.60	167,897.35
应付托管费		29,688.30	33,579.48

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.7	334,007.43	242,824.30
负债合计		512,458.76	444,301.13
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.3.8	331,258,387.00	364,258,387.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.9	25,421,393.04	10,740,888.14
净资产合计		356,679,780.04	374,999,275.14
<b>负债和净资产总计</b>		<b>357,192,238.80</b>	<b>375,443,576.27</b>

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0767 元，基金份额总额 331,258,387.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
<b>一、营业总收入</b>		18,305,696.44	27,650,513.77
1. 利息收入		10,875.81	11,575.62
其中：存款利息收入	6.4.3.10	10,875.81	11,575.62
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）		11,702,224.02	6,420,681.20
其中：股票投资收益	6.4.3.11	4,392,167.00	-369,358.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.12	-	274,195.21
资产支持证券投资收益	6.4.3.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.14	-	-
股利收益	6.4.3.15	7,310,057.02	6,515,844.47
以摊余成本计量的金融资产终止确		-	-

认产生的收益（若有）			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.16	6,589,595.75	21,173,894.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.17	3,000.86	44,362.58
<b>减：二、营业总支出</b>		1,313,207.07	1,537,749.82
1. 管理人报酬		965,712.11	1,153,125.21
2. 托管费		193,142.40	230,625.05
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.3.18	-	-
7. 税金及附加		-	0.47
8. 其他费用	6.4.3.19	154,352.56	153,999.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,992,489.37	26,112,763.95
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		16,992,489.37	26,112,763.95
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		16,992,489.37	26,112,763.95

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	364,258,387.00	-	10,740,888.14	374,999,275.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	364,258,387.00	-	10,740,888.14	374,999,275.14

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-33,000,000.00	-	14,680,504.90	-18,319,495.10
(一)、综合收益总额	-	-	16,992,489.37	16,992,489.37
(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)	-33,000,000.00	-	-2,311,984.47	-35,311,984.47
其中: 1. 基金申购款	115,000,000.00	-	15,697,853.46	130,697,853.46
2. 基金赎回款	-148,000,000.00	-	-18,009,837.93	-166,009,837.93
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	331,258,387.00	-	25,421,393.04	356,679,780.04
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	390,258,387.00	-	27,622,463.66	417,880,850.66
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	390,258,387.00	-	27,622,463.66	417,880,850.66
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	32,000,000.00	-	34,496,692.02	66,496,692.02
(一)、综合收益总额	-	-	26,112,763.95	26,112,763.95
(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)	32,000,000.00	-	8,383,928.07	40,383,928.07

其中：1. 基金申购款	322,000,000.00	-	23,396,513.78	345,396,513.78
2. 基金赎回款	-290,000,000.00	-	-15,012,585.71	-305,012,585.71
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	422,258,387.00	-	62,119,155.68	484,377,542.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：徐卫，会计机构负责人：佘方方

## 6.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增



值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 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	8,512,461.95
等于：本金	8,511,854.95
加：应计利息	607.00
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	8,512,461.95

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	373,918,147. 15	-	348,481,943.75	-25,436,203.40
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	373,918,147. 15	-	348,481,943.75	-25,436,203.40

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.3.5 其他权益工具投资

##### 6.4.3.5.1 其他权益工具投资情况

无。

**6.4.3.5.2 报告期末其他权益工具投资情况**

无。

**6.4.3.6 其他资产**

无余额。

**6.4.3.7 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	37,510.75
其中：交易所市场	37,510.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	212,194.12
合计	334,007.43

**6.4.3.8 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	364,258,387.00	364,258,387.00
本期申购	115,000,000.00	115,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-148,000,000.00	-148,000,000.00
本期末	331,258,387.00	331,258,387.00

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

**6.4.3.9 未分配利润**

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	21,118,987.23	-10,378,099.09	10,740,888.14
本期利润	10,402,893.62	6,589,595.75	16,992,489.37
本期基金份额交易产生的变动数	-2,278,886.34	-33,098.13	-2,311,984.47
其中：基金申购款	6,975,351.87	8,722,501.59	15,697,853.46
基金赎回款	-9,254,238.21	-8,755,599.72	-18,009,837.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,242,994.51	-3,821,601.47	25,421,393.04

**6.4.3.10 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	10,512.28
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	340.96
其他	22.57
合计	10,875.81

**6.4.3.11 股票投资收益**
**6.4.3.11.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,926,131.28
股票投资收益——赎回差价收入	-533,964.28
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	4,392,167.00

**6.4.3.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	26,717,163.56
减：卖出股票成本总额	21,718,258.39
减：交易费用	72,773.89
买卖股票差价收入	4,926,131.28

**6.4.3.11.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	166,009,837.93
减：现金支付赎回款总额	15,388.93
减：赎回股票成本总额	166,528,413.28
减：交易费用	-
赎回差价收入	-533,964.28

#### 6.4.3.12 债券投资收益

##### 6.4.3.12.1 债券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.3.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无发生额。

#### 6.4.3.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.3.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

##### 6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

#### 6.4.3.14 衍生工具收益

##### 6.4.3.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

##### 6.4.3.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无发生额。

#### 6.4.3.15 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	7,310,057.02
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	7,310,057.02

#### 6.4.3.16 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	6,589,595.75
——股票投资	6,589,595.75
——债券投资	-
——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	6,589,595.75

#### 6.4.3.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	3,000.86
合计	3,000.86

#### 6.4.3.18 信用减值损失

无。

#### 6.4.3.19 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行汇划费	50.00
合计	154,352.56

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.5 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东

博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“博时上证资源 ETF 联接基金”）	基金管理人管理的其他基金
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.6.2 关联方报酬

###### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	965,712.11	1,153,125.21
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

###### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	193,142.40	230,625.05

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

##### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

##### 6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

##### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

###### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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
招商证券	9,909,654.00	2.99%	10,545,420.00	2.90%
博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金	208,064,542.00	62.81%	245,396,042.00	67.37%

注：1. 除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

2. 持有的基金份额占基金总份额的比例为四舍五入后的结果。

#### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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-活期存款	8,512,461.95	10,512.28	6,370,386.14	10,591.28

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

#### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.6.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

无。

#### 6.4.8 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票
---------------------



证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	首次公开发行限售	19.86	18.06	2,296.00	45,598.56	41,465.76	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	首次公开发行限售	11.10	17.04	1,419.00	15,750.90	24,179.76	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	首次公开发行限售	5.69	5.41	4,120.00	23,442.80	22,289.20	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	首次公开发行限售	23.60	64.67	343.00	8,094.80	22,181.81	-
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	首次公开发行限售	135.80	120.41	143.00	19,419.40	17,218.63	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	首次公开发行限售	32.52	42.37	402.00	13,073.04	17,032.74	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	首次公开发行限售	12.68	22.31	726.00	9,205.68	16,197.06	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6个月	首次公开发行限售	37.88	29.49	546.00	20,682.48	16,101.54	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	首次公开发行限售	36.15	38.13	386.00	13,953.90	14,718.18	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	首次公开发行限售	26.74	40.68	355.00	9,492.70	14,441.40	-
68848	南芯	2023-	6个月	首次	39.99	36.71	390.00	15,59	14,31	-

4	科技	03-28		公开发 行限 售			0	6.10	6.90	
68854 3	国科 军工	2023- 06-14	6 个月	首次 公开 发行 限 售	43.67	53.05	260.0 0	11,35 4.20	13,79 3.00	-
68853 1	日联 科技	2023- 03-24	6 个月	首次 公开 发行 限 售	152.3 8	135.9 7	99.00	15,08 5.62	13,46 1.03	-
68862 9	华丰 科技	2023- 06-16	6 个月	首次 公开 发行 限 售	9.26	18.59	708.0 0	6,556 .08	13,16 1.72	-
68845 8	美芯 晟	2023- 05-15	6 个月	首次 公开 发行 限 售	75.00	90.76	137.0 0	10,27 5.00	12,43 4.12	-
68862 0	安凯 微	2023- 06-15	6 个月	首次 公开 发行 限 售	10.68	12.34	1,006 .00	10,74 4.08	12,41 4.04	-
68859 3	新相 微	2023- 05-25	6 个月	首次 公开 发行 限 售	11.18	14.59	845.0 0	9,447 .10	12,32 8.55	-
68855 2	航天 南湖	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限 售	21.17	23.50	523.0 0	11,07 1.91	12,29 0.50	-
68835 2	顾中 科技	2023- 04-11	6 个月	首次 公开 发行 限 售	12.10	12.07	964.0 0	11,66 4.40	11,63 5.48	-
68858 1	安杰 思	2023- 05-12	6 个月	首次 公开 发行 限 售	125.8 0	118.0 3	96.00	12,07 6.80	11,33 0.88	-
68851 2	慧智 微	2023- 05-08	6 个月	首次 公开 发行 限 售	20.92	19.16	588.0 0	12,30 0.96	11,26 6.08	-
68852 3	航天 环宇	2023- 05-26	6 个月	首次 公开	21.86	23.85	472.0 0	10,31 7.92	11,25 7.20	-

				发行 限售							
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	首次 公开发 行 限售	14.16	16.21	679.00	9,614.64	11,006.59	-	
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	首次 公开发 行 限售	26.66	31.50	328.00	8,744.48	10,332.00	-	
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	首次 公开发 行 限售	33.99	29.49	291.00	9,891.09	8,581.59	-	
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	首次 公开发 行 限售	25.28	29.87	287.00	7,255.36	8,572.69	-	
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	首次 公开发 行 限售	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-	
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	6.58	7.58	1,008.00	6,632.64	7,640.64	-	
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	首次 公开发 行 限售	17.80	17.89	360.00	6,408.00	6,440.40	-	
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	首次 公开发 行 限售	11.66	12.26	359.00	4,185.94	4,401.34	-	
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	首次 公开发 行 限售	10.36	11.84	350.00	3,626.00	4,144.00	-	
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	首次 公开发 行 限售	25.98	24.53	114.00	2,961.72	2,796.42	-	
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	首次 公开发 行	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-	

				限售						
60317 2	万丰 股份	2023- 04-28	6 个月	首次 公开 发行 限售	14.58	16.13	122.0 0	1,778 .76	1,967 .86	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的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。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪上证自然资源指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证自然资源指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、监察法律部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察法律部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系

统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 6.4.9.2 信用风险

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

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

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

##### 6.4.9.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.9.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.9.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.9.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.9.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.9.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于本期末，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。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

##### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

#### 6.4.9.4 市场风险

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

##### 6.4.9.4.1 利率风险

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

间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

#### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	8,512,461.95	-	-	-	8,512,461.95
结算备付金	43,735.62	-	-	-	43,735.62
存出保证金	1,861.93	-	-	-	1,861.93
交易性金融资产	-	-	-	348,481,943.75	348,481,943.75
应收清算款	-	-	-	152,235.55	152,235.55
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>8,558,059.50</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>348,634,179.30</b>	<b>357,192,238.80</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	321.43	321.43
应付管理人报酬	-	-	-	148,441.60	148,441.60
应付托管费	-	-	-	29,688.30	29,688.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	334,007.43	334,007.43
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>512,458.76</b>	<b>512,458.76</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>8,558,059.50</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>348,121,720.54</b>	<b>356,679,780.04</b>
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	4,800,907.60	-	-	-	4,800,907.60
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	5,180.05	-	-	-	5,180.05

交易性金融资产	-	-	-	370,347,699.65	370,347,699.65
应收清算款	-	-	-	289,788.97	289,788.97
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>4,806,087.65</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>370,637,488.62</b>	<b>375,443,576.27</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	167,897.35	167,897.35
应付托管费	-	-	-	33,579.48	33,579.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	242,824.30	242,824.30
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>444,301.13</b>	<b>444,301.13</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>4,806,087.65</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>370,193,187.49</b>	<b>374,999,275.14</b>

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

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期：同）。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

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

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



基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	348,481,943.75	97.70	370,347,699.65	98.76
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	348,481,943.75	97.70	370,347,699.65	98.76

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 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 1,724	增加约 1,855
业绩比较基准下降 5%	减少约 1,724	减少约 1,855	

### 6.4.10 公允价值

#### 6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	348,049,921.10
第二层次	-

第三层次	432,022.65
合计	348,481,943.75

#### 6.4.10.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	348,481,943.75	97.56
	其中：股票	348,481,943.75	97.56
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	8,556,197.57	2.40
8	其他各项资产	154,097.48	0.04

9	合计	357,192,238.80	100.00
---	----	----------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,754,124.63	0.77
B	采矿业	216,876,815.61	60.80
C	制造业	112,319,520.46	31.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,156,018.00	2.57
E	建筑业	6,776.85	0.00
F	批发和零售业	4,169,212.64	1.17
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	33,351.34	0.01
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	11,006.59	0.00
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	3,155,117.63	0.88
	合计	348,481,943.75	97.70

## 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

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	601088	中国神华	616,272	18,950,364.00	5.31
2	601225	陕西煤业	1,012,832	18,423,414.08	5.17
3	601899	紫金矿业	1,560,347	17,741,145.39	4.97
4	600111	北方稀土	731,008	17,529,571.84	4.91
5	601857	中国石油	2,280,270	17,033,616.90	4.78
6	600028	中国石化	2,670,951	16,987,248.36	4.76
7	603799	华友钴业	358,547	16,460,892.77	4.62
8	601600	中国铝业	2,301,570	12,635,619.30	3.54
9	600547	山东黄金	524,610	12,317,842.80	3.45
10	603993	洛阳钼业	2,050,911	10,931,355.63	3.06
11	600176	中国巨石	697,100	9,870,936.00	2.77
12	600938	中国海油	520,700	9,435,084.00	2.65

13	600157	永泰能源	6,447,900	9,156,018.00	2.57
14	600256	广汇能源	1,334,011	9,151,315.46	2.57
15	600489	中金黄金	844,070	8,719,243.10	2.44
16	600188	兖矿能源	266,684	7,979,185.28	2.24
17	688122	西部超导	132,022	7,357,586.06	2.06
18	600988	赤峰黄金	482,800	6,498,488.00	1.82
19	600219	南山铝业	2,039,024	6,157,852.48	1.73
20	603688	石英股份	52,200	5,942,448.00	1.67
21	601168	西部矿业	553,250	5,814,657.50	1.63
22	600362	江西铜业	300,454	5,702,616.92	1.60
23	601699	潞安环能	347,074	5,664,247.68	1.59
24	600392	盛和资源	407,376	5,242,929.12	1.47
25	600497	驰宏锌锗	1,034,858	5,194,987.16	1.46
26	600516	方大炭素	818,018	5,071,711.60	1.42
27	600777	新潮能源	1,973,800	4,993,714.00	1.40
28	600549	厦门钨业	246,693	4,694,567.79	1.32
29	601898	中煤能源	531,414	4,485,134.16	1.26
30	600711	盛屯矿业	911,600	4,430,376.00	1.24
31	600546	山煤国际	287,600	4,161,572.00	1.17
32	600348	华阳股份	523,459	4,140,560.69	1.16
33	601677	明泰铝业	281,041	3,900,849.08	1.09
34	600338	西藏珠峰	211,440	3,860,894.40	1.08
35	600583	海油工程	642,100	3,756,285.00	1.05
36	600985	淮北矿业	287,900	3,316,608.00	0.93
37	600673	东阳光	437,603	3,155,117.63	0.88
38	601958	金钼股份	281,378	3,137,364.70	0.88
39	601666	平煤股份	403,405	3,041,673.70	0.85
40	600456	宝钛股份	82,900	2,805,336.00	0.79
41	600598	北大荒	206,611	2,754,124.63	0.77
42	603876	鼎胜新材	128,100	2,458,239.00	0.69
43	601808	中海油服	172,011	2,387,512.68	0.67
44	601212	白银有色	859,900	2,338,928.00	0.66
45	601001	晋控煤业	243,243	2,276,754.48	0.64
46	600123	兰花科创	258,820	2,117,147.60	0.59
47	600259	广晟有色	58,399	2,110,539.86	0.59
48	600339	中油工程	486,500	1,980,055.00	0.56
49	600740	山西焦化	372,055	1,908,642.15	0.54
50	601952	苏垦农发	159,900	1,861,236.00	0.52
51	688249	晶合集成	2,296	41,465.76	0.01
52	688472	阿特斯	1,419	24,179.76	0.01
53	688469	中芯集成	4,120	22,289.20	0.01
54	688361	中科飞测	343	22,181.81	0.01
55	688576	西山科技	175	21,476.55	0.01
56	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00

57	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
58	688443	智翔金泰	546	16,101.54	0.00
59	688146	中船特气	386	14,718.18	0.00
60	688582	芯动联科	355	14,441.40	0.00
61	688593	新相微	965	14,381.75	0.00
62	688484	南芯科技	390	14,316.90	0.00
63	688543	国科军工	260	13,793.00	0.00
64	688531	日联科技	99	13,461.03	0.00
65	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
66	688458	美芯晟	137	12,434.12	0.00
67	688620	安凯微	1,006	12,414.04	0.00
68	688552	航天南湖	523	12,290.50	0.00
69	688352	顾中科技	964	11,635.48	0.00
70	688581	安杰思	96	11,330.88	0.00
71	688512	慧智微	588	11,266.08	0.00
72	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
73	688334	西高院	679	11,006.59	0.00
74	688433	华曙高科	328	10,332.00	0.00
75	688479	友车科技	291	8,581.59	0.00
76	688631	莱斯信息	287	8,572.69	0.00
77	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
78	601061	中信金属	1,008	7,640.64	0.00
79	603135	中重科技	360	6,440.40	0.00
80	601133	柏诚股份	359	4,401.34	0.00
81	601065	江盐集团	350	4,144.00	0.00
82	603125	常青科技	114	2,796.42	0.00
83	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
84	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600583	海油工程	4,021,679.00	1.07
2	603799	华友钴业	3,461,029.00	0.92
3	600111	北方稀土	2,729,782.00	0.73
4	603876	鼎胜新材	2,481,523.40	0.66
5	600938	中国海油	1,837,997.00	0.49
6	601225	陕西煤业	1,806,444.00	0.48
7	600988	赤峰黄金	1,654,880.00	0.44
8	600777	新潮能源	1,181,500.00	0.32

9	600516	方大炭素	1,098,902.00	0.29
10	600711	盛屯矿业	944,134.00	0.25
11	688249	晶合集成	455,826.72	0.12
12	600157	永泰能源	431,606.00	0.12
13	600028	中国石化	378,240.00	0.10
14	601088	中国神华	366,695.00	0.10
15	603993	洛阳钼业	319,419.00	0.09
16	601857	中国石油	256,869.00	0.07
17	601600	中国铝业	254,918.00	0.07
18	600547	山东黄金	239,906.00	0.06
19	688469	中芯集成	234,376.79	0.06
20	601899	紫金矿业	227,058.00	0.06

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

#### 7.4.2 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	600028	中国石化	8,122,006.80	2.17
2	601857	中国石油	4,089,526.00	1.09
3	600737	中粮糖业	2,637,564.00	0.70
4	601118	海南橡胶	2,338,196.00	0.62
5	601899	紫金矿业	2,309,222.00	0.62
6	688249	晶合集成	413,199.26	0.11
7	688435	英方软件	309,169.63	0.08
8	688392	骄成超声	288,451.08	0.08
9	688361	中科飞测	231,965.62	0.06
10	688469	中芯集成	215,382.51	0.06
11	688152	麒麟信安	198,230.40	0.05
12	688576	西山科技	179,732.51	0.05
13	688562	航天软件	174,622.95	0.05
14	688472	阿特斯	172,538.78	0.05
15	688486	龙迅股份	172,496.25	0.05
16	688478	晶升股份	169,379.97	0.05
17	688593	新相微	156,981.10	0.04
18	688146	中船特气	155,306.93	0.04
19	688582	芯动联科	152,719.31	0.04
20	688522	纳睿雷达	152,443.30	0.04

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	31,515,471.82
---------------	---------------

卖出股票的收入（成交）总额	26,717,163.56
---------------	---------------

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

### 7.12.3 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	1,861.93
2	应收清算款	152,235.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	154,097.48

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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		博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,899	67,617.55	57,049,177.00	17.22%	66,144,668.00	19.97%	208,064,542.00	62.81%



## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
-	中国建设银行－博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金	208,064,542.00	62.81%
1	招商证券股份有限公司	9,909,654.00	2.99%
2	华夏基金－中央汇金资产管理有限责任公司－华夏基金－汇金资管单一资产管理计划	7,577,900.00	2.29%
3	长江养老保险股份有限公司－中国太平洋人寿权益基金型投资产品（财富管家）委托专户	7,516,700.00	2.27%
4	广发证券股份有限公司	6,368,800.00	1.92%
5	中国平安财产保险股份有限公司－传统－普通保险产品	6,085,600.00	1.84%
6	博时基金－招商银行－博时基金汇利 1 号集合资产管理计划	3,634,600.00	1.10%
7	中信证券股份有限公司	2,818,180.00	0.85%
8	方正证券股份有限公司	2,455,400.00	0.74%
9	范新田	1,800,000.00	0.54%
10	黎嫚	1,693,111.00	0.51%

注：1. 以上数据由中国证券登记结算公司提供，由于系统字数限制可能有持有人名称显示不全的情况，持有人为场内持有人。

2. 前十名持有人为除联接基金之外的前十名持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人从业人员未持有本基金。

## 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

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 4 月 10 日）基金份额总额	910,258,387.00
本报告期期初基金份额总额	364,258,387.00
本报告期基金总申购份额	115,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	148,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	331,258,387.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，邵凯先生离任公司副总经理，继续担任公司投资决策委员会委员。

基金管理人于 2023 年 5 月 27 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，孙献离任公司财务负责人；吴慧峰任公司副总经理、财务负责人。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	增加 1 个
招商证券	1	-	-	-	-	增加 1 个
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	692,725.32	1.29%	506.59	1.28%	-
申万宏源	1	50,002,856.81	93.11%	36,568.15	92.64%	增加 1 个
天风证券	2	1,456,285.14	2.71%	1,064.99	2.70%	增加 1 个
东吴证券	1	-	-	-	-	增加 1 个
方正证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	130,710.86	0.24%	121.77	0.31%	-
民生证券	1	81,034.49	0.15%	59.27	0.15%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	881,398.22	1.64%	820.83	2.08%	-
中信证	2	455,564.62	0.85%	333.21	0.84%	增加 1

券						个
---	--	--	--	--	--	---

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

1、基金专用交易席位的选择标准如下：

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

2、基金专用交易席位的选择程序如下：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	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
安信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增开源证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-16

2	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增国金证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-09
3	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230601	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-06-01
4	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增华福证券为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-30
5	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-05-27
6	上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-04-22
7	上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-03-30
8	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-18
9	博时基金管理有限公司关于直销网上交易开通兴业银行快捷开户和支付服务及费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-13
10	关于博时基金管理有限公司旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购、赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-02-08
11	上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-20
12	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20230104	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2023-01-04

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		的时间区间					
博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2023-01-01~ 2023-06-30	245,396,042. 00	-	37,331,500 .00	208,064,54 2.00	62.81%

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过20%的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- 2、《上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日