

嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数  
证券投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 25 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 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</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 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证稀有金属主题 ETF
场内简称	稀有金属（扩位场内简称：稀有金属 ETF）
基金主代码	562800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 15 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,739,695,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 9 月 27 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，力争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%。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。</p> <p>具体投资策略包括：股票投资策略、金融衍生品投资策略、融资及转融通证券出借业务的投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券与可交换公司债券投资策略。</p>
业绩比较基准	中证稀有金属主题指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国银河证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95551; 400-888-8888
传真	(010)65215588	010-80928078

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号青海金融大厦
邮政编码	100020	100073
法定代表人	经雷	陈亮

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-50,241,443.11
本期利润	-92,929,047.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0715
本期加权平均净值利润率	-10.75%
本期基金份额净值增长率	-8.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-673,970,578.87
期末可供分配基金份额利润	-0.3874
期末基金资产净值	1,065,724,421.13
期末基金份额净值	0.6126
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-38.74%

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.19%	1.40%	1.44%	1.39%	0.75%	0.01%
过去三个月	-7.95%	1.64%	-9.22%	1.65%	1.27%	-0.01%
过去六个月	-8.88%	1.46%	-10.07%	1.47%	1.19%	-0.01%
过去一年	-34.26%	1.71%	-35.22%	1.72%	0.96%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-38.74%	2.13%	-44.29%	2.18%	5.55%	-0.05%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = \text{中证稀有金属主题指数}(t) / \text{中证稀有金属主题指数}(t-1) - 1$$

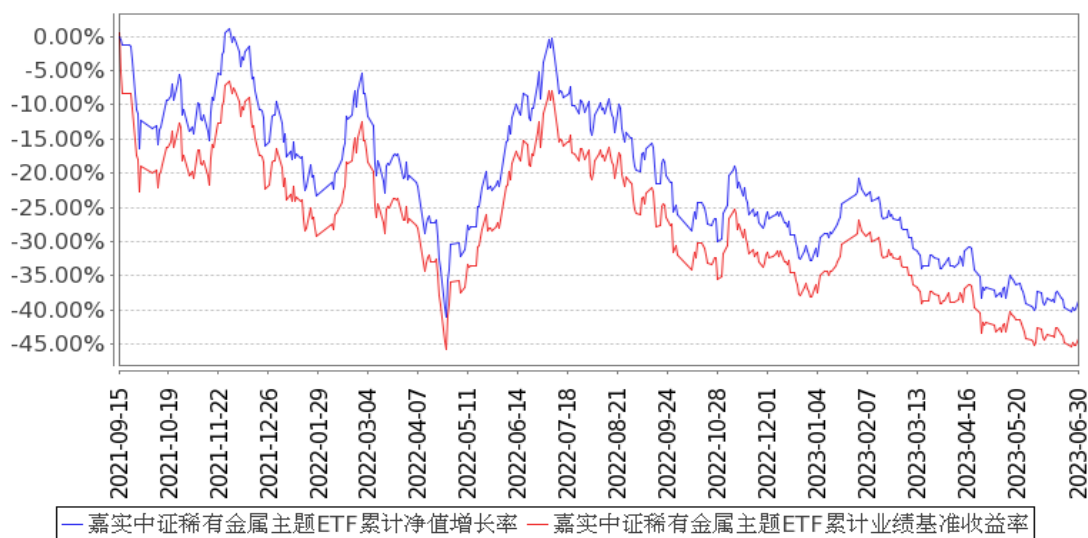
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日。

### 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

#### 嘉实中证稀有金属主题ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年09月15日至2023年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## 3.3 其他指标

无。

## § 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2023年6月30日，基金管理人共管理314只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
田光远	本基金、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实中证沪港深互联网ETF、嘉实中证软件服务ETF、嘉实中证稀土产业ETF、嘉实中证电池主题ETF、嘉实中证稀土产业ETF联接、嘉实中证新能源ETF、嘉实中证软件服务ETF联接、嘉	2021年9月15日	-	8年	曾任华创证券有限责任公司资产管理部量化研究员，2017年4月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部，从事指数基金投资研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。



	实中证海外中国互联网 30ETF (QDII)、嘉实中证稀有金属主题 ETF 发起联接、嘉实中证芯片产业指数发起式、嘉实中证电池主题 ETF 发起联接、嘉实上证科创板芯片 ETF、嘉实上证科创板芯片 ETF 发起联接、嘉实北证 50 成份指数基金经理				
--	---	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和

公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与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，合计 6 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

### 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

本基金跟踪中证稀有金属主题指数，中证稀有金属主题指数以中证全指为样本空间，选取归属于稀有金属行业的上市公司股票作为成份股，以反映稀有金属行业上市公司整体表现，为市场提供多样化的投资标的。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，在高通胀、美联储持续加息及地缘政治风险的共同作用下，全球经济波动加剧。全球主要经济体步入去库周期，制造业 PMI 进入下行趋势，多个指标表明全球经济依然存在衰退风险。但受益于服务业的持续高景气，全球经济下行势头趋缓。国内方面，上半年，我国经济总体呈现恢复性向好态势，一季度政策前置发力下，国内经济实现良好开局，一季度 GDP 同比增长 4.5%，二季度在海外风险加大、外需减弱和内需增长动力不足等影响下，国内经济增长边际放缓，但在去年低基数效应下，二季度 GDP 同比增长 6.3%，上半年同比增长 5.5%，总体保持持续向好态势。

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.05%，年化跟踪误差为 0.74%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.6126 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.88%，业绩比较基准收益率为-10.07%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证稀有金属主题指数的被动投资管理产品，将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对指数成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证稀有金属主题指数的投资工具。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 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，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### 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

本报告期内，中国银河证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人按照《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配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。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法复核嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：嘉实中证稀有金属主题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	6.4.7.1	12,024,437.17	2,156,131.74
结算备付金		1,604,069.86	1,772,287.38
存出保证金		686,193.67	1,051,721.13
交易性金融资产	6.4.7.2	1,052,251,781.02	657,702,719.40
其中：股票投资		1,052,251,781.02	657,702,719.40
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		10,132,792.51	2,843,260.27
应收股利		744,953.99	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	54,362.32	18,522.16
资产总计		1,077,498,590.54	665,544,642.08
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		10,620,526.63	2,998,476.23
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		431,461.05	294,492.43
应付托管费		86,292.18	58,898.49
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,756.77	605.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	630,132.78	549,640.57
负债合计		11,774,169.41	3,902,112.97
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,739,695,000.00	984,145,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-673,970,578.87	-322,502,470.89
净资产合计		1,065,724,421.13	661,642,529.11
负债和净资产总计		1,077,498,590.54	665,544,642.08

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.6126 元，基金份额总额 1,739,695,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实中证稀有金属主题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>		-90,263,069.82	38,214,715.81
1. 利息收入		702,117.70	30,841.31
其中：存款利息收入	6.4.7.13	27,008.58	30,841.31
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		675,109.12	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-49,897,295.88	-57,051,027.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-60,700,489.33	-59,905,795.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	845,868.43
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	10,803,193.45	2,008,899.49
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-42,687,604.50	91,974,421.21
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,619,712.86	3,260,480.82
<b>减：二、营业总支出</b>		2,665,977.79	1,937,341.93
1. 管理人报酬		2,139,039.96	1,541,799.75
2. 托管费		427,807.89	308,359.91
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,430.69	1.82
8. 其他费用	6.4.7.23	96,699.25	87,180.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-92,929,047.61	36,277,373.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-92,929,047.61	36,277,373.88
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-92,929,047.61	36,277,373.88

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	984,145,000.00	-	-322,502,470.89	661,642,529.11

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	984,145,000.00	-	-322,502,470.89	661,642,529.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	755,550,000.00	-	-351,468,107.98	404,081,892.02
(一)、综合收益总额	-	-	-92,929,047.61	-92,929,047.61
(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)	755,550,000.00	-	-258,539,060.37	497,010,939.63
其中:1.基金申购款	1,369,350,000.00	-	-455,849,097.97	913,500,902.03
2.基金赎回款	-613,800,000.00	-	197,310,037.60	-416,489,962.40
(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)	1,739,695,000.00	-	-673,970,578.87	1,065,724,421.13
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	643,945,000.00	-	-61,183,027.13	582,761,972.87
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)	643,945,000.00	-	-61,183,027.13	582,761,972.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	237,150,000.00	-	1,075,347.88	238,225,347.88
(一)、综合收益总额	-	-	36,277,373.88	36,277,373.88
(二)、本期基金份额交易产	237,150,000.00	-	-35,202,026.00	201,947,974.00



生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	1,254,150,000.00	-	-218,904,717.45	1,035,245,282.55
2. 基金赎回款	-1,017,000,000.00	-	183,702,691.45	-833,297,308.55
(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、本期末净资产(基金净值)	881,095,000.00	-	-60,107,679.25	820,987,320.75

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：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]1730号《关于准予嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于2021年9月6日至2021年9月10日向社会公开募集，基金合同于2021年9月15日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为606,145,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银河证券股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及自2023年1月1日起至2023年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入

为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	12,024,437.17
等于：本金	12,023,135.91
加：应计利息	1,301.26
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	12,024,437.17

#### 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	1,239,311,125.87	-	1,052,251,781.02	-187,059,344.85
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	1,239,311,125.87	-	1,052,251,781.02	-187,059,344.85

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 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

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 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	54,362.32
待摊费用	-
合计	54,362.32

## 6.4.7.9 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	458,433.53
其中：交易所市场	458,433.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	171,699.25
合计	630,132.78

#### 6.4.7.10 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	984,145,000.00	984,145,000.00
本期申购	1,369,350,000.00	1,369,350,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-613,800,000.00	-613,800,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,739,695,000.00	1,739,695,000.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 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	-114,425,705.03	-208,076,765.86	-322,502,470.89
本期利润	-50,241,443.11	-42,687,604.50	-92,929,047.61
本期基金份额交易产生的变动数	-106,150,688.56	-152,388,371.81	-258,539,060.37
其中：基金申购款	-191,598,418.96	-264,250,679.01	-455,849,097.97
基金赎回款	85,447,730.40	111,862,307.20	197,310,037.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-270,817,836.70	-403,152,742.17	-673,970,578.87

#### 6.4.7.13 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
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	10,458.87

其他	5,651.43
合计	27,008.58

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 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	-48,226,364.66
股票投资收益——赎回差价收入	-12,474,124.67
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	-60,700,489.33

##### 6.4.7.14.2 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	365,075,202.85
减：卖出股票成本总额	412,172,244.95
减：交易费用	1,129,322.56
买卖股票差价收入	-48,226,364.66

##### 6.4.7.14.3 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	416,489,962.40
减：现金支付赎回款总额	292,222,661.40
减：赎回股票成本总额	136,741,425.67
减：交易费用	-
赎回差价收入	-12,474,124.67

##### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。



6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 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	10,803,193.45
其中：证券出借权益补偿收入	1,331,050.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,803,193.45

## 6.4.7.20 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	-42,687,604.50
股票投资	-42,687,604.50
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	-42,687,604.50

## 6.4.7.21 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	1,619,712.86
合计	1,619,712.86

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 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	37,191.88
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
合计	96,699.25

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国银河证券股份有限公司（“中国银河证券”）	基金托管人
嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“嘉实中证稀有金属主题 ETF 发起联接”）	本基金的联接基金

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 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 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	2,139,039.96	1,541,799.75
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 支付基金管理人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。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

### 6.4.10.2.2 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	427,807.89	308,359.91

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。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

### 6.4.10.4 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

无。

#### 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

无。

### 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

无。

#### 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

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(%)
嘉实中证稀有金属主题ETF发起联接	548,800,800.00	31.55	278,205,800.00	28.27

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银河证券股份有限公司_活期	12,024,437.17	10,898.28	8,354,082.98	9,292.05

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期(2023年1月1日至2023年6月30日),本基金未实施利润分配。

#### 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
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,028	12,212.64	21,608.56	-
001324	长青	2023年	6个月	新股锁	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

	科技	5月12日		定							
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05		-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99		-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40		-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60		-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22		-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78		-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新发未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92		-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00		-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新发未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20		-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00		-

301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

		日									
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新发未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60		-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	2,279	14,995.82	17,274.82		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	856	8,868.16	10,135.04		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	640	7,462.40	7,846.40		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	688	24,871.20	26,233.44		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	4,060	80,631.60	73,323.60		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48		-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	2,043	24,720.30	24,659.01		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	718	16,944.80	46,433.06		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙	2023年	6个月	新股锁	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00		-



	高科	4月7日		定							
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96		-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	8,494	48,330.86	45,952.54		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	4,459	49,494.90	75,981.36		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	692	27,673.08	25,403.32		-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定	245.56	122.11	172	28,484.96	21,002.92		-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50		-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72		-

688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股锁定	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 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	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000792	盐湖股份	2023年7月4日-2023年7月12日	19.17	850,300	16,300,251.00
2	603799	华友钴业	2023年7月3日-2023年7月14日	45.91	316,600	14,535,106.00
3	002466	天齐锂业	2023年7月4日-2023年7月12日	69.91	161,900	11,318,429.00
4	002460	赣锋锂业	2023年7月4日-2023年7月12日	60.96	176,300	10,747,248.00
5	600111	北方稀土	2023年7月4日-2023年7月12日	23.98	321,900	7,719,162.00
6	002738	中矿资源	2023年7月4日-2023年7月14日	50.94	134,600	6,856,524.00
7	002497	雅化集团	2023年7月4日-2023年7月13日	17.78	286,600	5,095,748.00
8	002176	江特电机	2023年7月4日-2023年7月13日	11.92	421,800	5,027,856.00
9	002756	永兴材料	2023年7月4日-2023年7月13日	62.61	79,700	4,990,017.00
10	603993	洛阳钼业	2023年7月4日-2023年7月12日	5.33	899,900	4,796,467.00
11	000629	钒钛股份	2023年7月4日-2023年7月14日	3.91	1,068,700	4,178,617.00
12	300390	天华新能	2023年7月4日-2023年7月14日	35.80	115,100	4,120,580.00
13	000831	中国稀土	2023年7月4日-2023年7月12日	29.60	134,100	3,969,360.00
14	000970	中科三环	2023年7月3日-2023年7月13日	12.82	230,600	2,956,292.00
15	688122	西部超导	2023年7月4日-2023年7月12日	55.73	48,560	2,706,248.80
16	000960	锡业股份	2023年7月4日-2023年7月13日	15.55	164,600	2,559,530.00
17	000060	中金岭南	2023年7月3日-2023年7月14日	4.75	496,100	2,356,475.00
18	002240	盛新锂能	2023年7月4日-2023年7月13日	31.87	73,400	2,339,258.00
19	002192	融捷股份	2023年7月4日-2023年7月13日	66.83	34,900	2,332,367.00
20	002056	横店东	2023年7月4日-2023年	18.21	127,000	2,312,670.00

		磁	7月12日			.00
21	600392	盛和资源	2023年7月4日-2023年7月12日	12.87	178,300	2,294,721.00
22	000155	川能动力	2023年7月4日-2023年7月14日	14.40	158,200	2,278,080.00
23	600549	厦门钨业	2023年7月4日-2023年7月12日	19.03	108,000	2,055,240.00
24	300748	金力永磁	2023年7月4日-2023年7月12日	29.92	67,000	2,004,640.00
25	000762	西藏矿业	2023年7月4日-2023年7月12日	29.63	65,300	1,934,839.00
26	300224	正海磁材	2023年7月4日-2023年7月14日	12.86	123,500	1,588,210.00
27	002428	云南锗业	2023年7月3日-2023年7月13日	12.16	130,500	1,586,880.00
28	600331	宏达股份	2023年7月3日-2023年7月14日	4.74	304,100	1,441,434.00
29	002149	西部材料	2023年7月4日-2023年7月13日	16.79	82,800	1,390,212.00
30	601958	金铂股份	2023年7月4日-2023年7月12日	11.15	123,000	1,371,450.00
31	000795	英洛华	2023年7月4日-2023年7月13日	7.58	168,000	1,273,440.00
32	600456	宝钛股份	2023年7月4日-2023年7月12日	33.84	36,500	1,235,160.00
33	000657	中钨高新	2023年7月4日-2023年7月12日	9.69	124,700	1,208,343.00
34	002167	东方锆业	2023年7月3日-2023年7月14日	7.48	153,100	1,145,188.00
35	300618	寒锐钴业	2023年7月4日-2023年7月12日	32.41	33,600	1,088,976.00
36	600206	有研新材	2023年7月4日-2023年7月12日	13.14	75,300	989,442.00
37	600259	广晟有色	2023年7月4日-2023年7月12日	36.14	25,600	925,184.00
38	603399	吉翔股份	2023年7月4日-2023年7月14日	11.57	77,200	893,204.00
39	600367	红星发展	2023年7月3日-2023年7月13日	14.43	51,700	746,031.00
40	002378	章源钨业	2023年7月3日-2023年7月14日	5.82	120,800	703,056.00
41	002667	威领股份	2023年7月4日-2023年7月12日	16.78	35,800	600,724.00
42	002978	安宁股	2023年7月4日-2023年	32.11	17,400	558,714.00

		份	7月14日			0
43	688077	大地熊	2023年7月4日-2023年7月14日	30.21	13,400	404,814.00
44	600366	宁波韵升	2023年7月3日-2023年7月12日	8.87	44,200	392,054.00
45	688190	云路股份	2023年7月4日-2023年7月12日	73.00	4,100	299,300.00
合计	-	-	-	-	8,464,760	147,627,541.80

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评

估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出

回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 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	12,024,437.17	-	-	-	12,024,437.17
结算备付金	1,604,069.86	-	-	-	1,604,069.86
存出保证金	686,193.67	-	-	-	686,193.67
交易性金融资产	-	-	-	1,052,251,781.02	1,052,251,781.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	10,132,792.51	10,132,792.51
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	744,953.99	744,953.99
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	54,362.32	54,362.32
资产总计	14,314,700.70	-	-	1,063,183,889.84	1,077,498,590.54
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	10,620,526.63	10,620,526.63

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	431,461.05	431,461.05
应付托管费	-	-	-	86,292.18	86,292.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,756.77	5,756.77
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	630,132.78	630,132.78
负债总计	-	-	-	11,774,169.41	11,774,169.41
利率敏感度缺口	14,314,700.70	-	-	-1,051,409,720.43	1,065,724,421.13
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,156,131.74	-	-	-	2,156,131.74
结算备付金	1,772,287.38	-	-	-	1,772,287.38
存出保证金	1,051,721.13	-	-	-	1,051,721.13
交易性金融资产	-	-	-	657,702,719.40	657,702,719.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,843,260.27	2,843,260.27
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	18,522.16	18,522.16
资产总计	4,980,140.25	-	-	660,564,501.83	665,544,642.08
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	2,998,476.23	2,998,476.23
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	294,492.43	294,492.43
应付托管费	-	-	-	58,898.49	58,898.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	605.25	605.25
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	549,640.57	549,640.57
负债总计	-	-	-	3,902,112.97	3,902,112.97
利率敏感度缺口	4,980,140.25	-	-	656,662,388.86	661,642,529.11



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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

#### 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	1,052,251,781.02	98.74	657,702,719.40	99.40
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	1,052,251,781.02	98.74	657,702,719.40	99.40

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	52,920,894.27	32,744,220.44
	业绩比较基准下降5%	-52,920,894.27	-32,744,220.44

#### 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	1,050,823,289.45	657,702,719.40
第二层次	366,947.18	-
第三层次	1,061,544.39	-
合计	1,052,251,781.02	657,702,719.40

##### 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。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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	1,052,251,781.02	97.66
	其中：股票	1,052,251,781.02	97.66

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	13,628,507.03	1.26
8	其他各项资产	11,618,302.49	1.08
9	合计	1,077,498,590.54	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 147,627,541.80 元，占基金资产净值的比例为 13.85%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	103,626,326.00	9.72
C	制造业	934,241,283.45	87.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,955,680.00	1.22
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,050,823,289.45	98.60

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,177,264.72	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	7,846.40	0.00
F	批发和零售业	48,337.58	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	113,678.06	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	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	1,428,491.57	0.13

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000792	盐湖股份	6,648,600	127,453,662.00	11.96
2	002466	天齐锂业	1,262,654	88,272,141.14	8.28

3	002460	赣锋锂业	1,385,596	84,465,932.16	7.93
4	600111	北方稀土	3,092,982	74,169,708.36	6.96
5	603799	华友钴业	1,563,970	71,801,862.70	6.74
6	603993	洛阳钼业	8,647,700	46,092,241.00	4.32
7	002738	中矿资源	700,328	35,674,708.32	3.35
8	688122	西部超导	541,736	30,190,947.28	2.83
9	300390	天华新能	719,096	25,743,636.80	2.42
10	002497	雅化集团	1,414,200	25,144,476.00	2.36
11	002240	盛新锂能	781,076	24,892,892.12	2.34
12	002176	江特电机	2,085,800	24,862,736.00	2.33
13	002756	永兴材料	395,658	24,772,147.38	2.32
14	600392	盛和资源	1,705,475	21,949,463.25	2.06
15	000831	中国稀土	721,700	21,362,320.00	2.00
16	000629	钒钛股份	5,268,000	20,597,880.00	1.93
17	600549	厦门钨业	1,042,522	19,839,193.66	1.86
18	000960	锡业股份	1,207,300	18,773,515.00	1.76
19	002056	横店东磁	999,900	18,208,179.00	1.71
20	002192	融捷股份	257,800	17,228,774.00	1.62
21	300748	金力永磁	520,400	15,570,368.00	1.46
22	000970	中科三环	1,189,550	15,250,031.00	1.43
23	000060	中金岭南	3,200,700	15,203,325.00	1.43
24	000762	西藏矿业	507,000	15,022,410.00	1.41
25	601958	金钼股份	1,181,900	13,178,185.00	1.24
26	000155	川能动力	899,700	12,955,680.00	1.22
27	600456	宝钛股份	351,500	11,894,760.00	1.12
28	600206	有研新材	725,400	9,531,756.00	0.89
29	600259	广晟有色	250,000	9,035,000.00	0.85
30	300618	寒锐钴业	268,500	8,702,085.00	0.82
31	000657	中钨高新	853,060	8,266,151.40	0.78
32	600331	宏达股份	1,743,500	8,264,190.00	0.78
33	002428	云南锗业	643,100	7,820,096.00	0.73
34	300224	正海磁材	606,900	7,804,734.00	0.73
35	600366	宁波韵升	814,900	7,228,163.00	0.68
36	300811	铂科新材	118,440	7,040,073.60	0.66
37	002149	西部材料	417,500	7,009,825.00	0.66
38	000795	英洛华	830,900	6,298,222.00	0.59
39	002167	东方锆业	759,300	5,679,564.00	0.53
40	000751	锌业股份	1,384,800	4,569,840.00	0.43
41	603399	吉翔股份	380,736	4,405,115.52	0.41
42	000962	东方钽业	329,000	4,030,250.00	0.38
43	600367	红星发展	254,066	3,666,172.38	0.34
44	002378	章源钨业	593,260	3,452,773.20	0.32
45	600961	株冶集团	393,200	3,180,988.00	0.30

46	688190	云路股份	42,885	3,130,605.00	0.29
47	002978	安宁股份	95,600	3,069,716.00	0.29
48	002667	威领股份	182,600	3,064,028.00	0.29
49	300127	银河磁体	163,700	2,967,881.00	0.28
50	688077	大地熊	67,358	2,034,885.18	0.19

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
2	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
3	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
4	688472	阿特斯	4,459	75,981.36	0.01
5	688249	晶合集成	4,060	73,323.60	0.01
6	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
7	688361	中科飞测	718	46,433.06	0.00
8	688469	中芯集成	8,494	45,952.54	0.00
9	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
10	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
11	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
12	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
13	688146	中船特气	688	26,233.44	0.00
14	688484	南芯科技	692	25,403.32	0.00
15	688352	颀中科技	2,043	24,659.01	0.00
16	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
17	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
18	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
19	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
20	001287	中电港	1,028	21,608.56	0.00
21	688507	索辰科技	172	21,002.92	0.00
22	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
23	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
24	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
25	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
26	601061	中信金属	2,279	17,274.82	0.00
27	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
28	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
29	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
30	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
31	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
32	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
33	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
34	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
35	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00

36	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
37	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
38	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
39	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
40	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
41	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
42	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
43	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
44	601065	江盐集团	856	10,135.04	0.00
45	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
46	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
47	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
48	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
49	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
50	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
51	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
52	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
53	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
54	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
55	601133	柏诚股份	640	7,846.40	0.00
56	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
57	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
58	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
59	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
60	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
61	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
62	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
63	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
64	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
65	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
66	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
67	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
68	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	000792	盐湖股份	120,802,674.54	18.26
2	002460	赣锋锂业	82,951,114.68	12.54
3	002466	天齐锂业	77,442,547.76	11.70
4	002738	中矿资源	30,131,533.71	4.55
5	002756	永兴材料	28,909,161.91	4.37



6	002176	江特电机	27,131,899.25	4.10
7	002497	雅化集团	25,692,335.82	3.88
8	002192	融捷股份	24,925,378.52	3.77
9	300390	天华新能	23,082,736.16	3.49
10	002240	盛新锂能	21,876,281.93	3.31
11	000831	中国稀土	21,449,269.66	3.24
12	000629	钒钛股份	20,245,681.02	3.06
13	002056	横店东磁	18,256,522.00	2.76
14	688122	西部超导	15,357,333.64	2.32
15	000960	锡业股份	14,360,180.49	2.17
16	000762	西藏矿业	13,243,864.90	2.00
17	000060	中金岭南	12,888,413.00	1.95
18	000970	中科三环	12,318,405.26	1.86
19	300618	寒锐钴业	12,115,387.71	1.83
20	300748	金力永磁	11,576,312.00	1.75

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000792	盐湖股份	59,497,087.85	8.99
2	002460	赣锋锂业	43,857,313.37	6.63
3	002466	天齐锂业	36,406,663.66	5.50
4	002192	融捷股份	16,237,319.31	2.45
5	002756	永兴材料	15,441,396.98	2.33
6	002176	江特电机	14,198,344.00	2.15
7	002497	雅化集团	13,372,243.00	2.02
8	002738	中矿资源	12,369,294.60	1.87
9	000831	中国稀土	10,751,183.81	1.62
10	002240	盛新锂能	10,647,007.25	1.61
11	002056	横店东磁	9,811,365.00	1.48
12	000629	钒钛股份	9,679,234.00	1.46
13	300390	天华新能	9,229,427.37	1.39
14	300618	寒锐钴业	7,494,505.28	1.13
15	000960	锡业股份	6,884,513.00	1.04
16	000060	中金岭南	6,239,851.00	0.94
17	000970	中科三环	5,854,768.29	0.88
18	000762	西藏矿业	5,690,232.90	0.86
19	000155	川能动力	4,946,899.00	0.75
20	000657	中钨高新	4,570,198.00	0.69

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	722,036,379.90
卖出股票收入（成交）总额	365,075,202.85

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，江西赣锋锂业集团股份有限公司出现本期被监管部门立案调查，江西赣锋锂业集团股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

##### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的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	686,193.67
2	应收清算款	10,132,792.51
3	应收股利	744,953.99
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	54,362.32
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,618,302.49

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000792	盐湖股份	16,300,251.00	1.53	转融通出借证券
2	603799	华友钴业	14,535,106.00	1.36	转融通出借证券
3	002466	天齐锂业	11,318,429.00	1.06	转融通出借证券
4	002460	赣锋锂业	10,747,248.00	1.01	转融通出借证券
5	600111	北方稀土	7,719,162.00	0.72	转融通出借证券
6	002738	中矿资源	6,856,524.00	0.64	转融通出借证券
7	002497	雅化集团	5,095,748.00	0.48	转融通出借证券
8	603993	洛阳钼业	4,796,467.00	0.45	转融通出借证券
9	300390	天华新能	4,120,580.00	0.39	转融通出借证券
10	688122	西部超导	2,706,248.80	0.25	转融通出借证券

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	301395	仁信新材	124,755.68	0.01	新发未上市
1	301395	仁信新材	13,873.60	0.00	新股锁定
2	301202	朗威股份	71,108.28	0.01	新发未上市
2	301202	朗威股份	7,900.92	0.00	新股锁定
3	688603	天承科技	68,805.00	0.01	新发未上市
3	688603	天承科技	7,700.00	0.00	新股锁定
4	688472	阿特斯	75,981.36	0.01	新股锁定
5	688249	晶合集成	73,323.60	0.01	新股锁定

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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

## 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
21,358	81,454.02	717,824,191.00	41.26	1,021,870,809.00	58.74

## 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实中证稀有金属主题交易 型开放式指数证券投资基金 发起式联接基金	548,800,800.00	31.55

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	深圳市凯诺进出口贸易 有限公司	25,000,000.00	1.44
2	中国平安人寿保险股 份有限公司—投连— 发展投资账户	20,000,000.00	1.15
3	招商证券股份有限公 司	15,677,053.00	0.90
4	平安资产—工商银行 —平安资产如意 11 号 保险资产管理产品	10,000,000.00	0.57
5	中信建投证券股份有 限公司	9,744,659.00	0.56
6	方正证券股份有限公 司	9,628,251.00	0.55
7	中信证券股份有限公 司	9,367,261.00	0.54
8	刘西瑜	8,364,700.00	0.48
9	广发证券股份有限公 司	8,083,953.00	0.46
10	俞兴木	6,000,000.00	0.34
11	嘉实中证稀有金属主	548,800,800.00	31.55

	题交易型开放式指数 证券投资基金发起式 联接基金		
--	--------------------------------	--	--

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	66,300.00	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情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年9月15日） 基金份额总额	606,145,000.00
本报告期期初基金份额总额	984,145,000.00
本报告期基金总申购份额	1,369,350,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	613,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,739,695,000.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### （1）基金管理人的重大人事变动情况

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，张峰先生任公司副总经理。

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，程剑先生任公司副总经理。

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李明先生任公司财务总监。

2023年6月20日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，

姚志鹏先生任公司副总经理。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人于 2023 年 5 月 18 日发布《关于中国银河证券股份有限公司托管总部总经理变更的公告》，中国银河证券股份有限公司托管总部总经理自 2023 年 5 月 17 日起变更为鹿宁，罗黎明不再担任托管总部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为安永华明会计师事务所（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

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内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

本基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内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 (%)	
华泰证券股份有限公司	2	916,575,091.33	85.15	578,660.41	85.15	-
平安证券股份有限公司	2	159,807,082.19	14.85	100,886.16	14.85	-
中国银河证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券

商的佣金合计。

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 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	嘉实基金管理有限公司关于防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年3月21日
2	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年4月29日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年6月20日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	2023-01-01 至 2023-06-30	278,205,800.00	671,000,000.00	400,405,000.00	548,800,800.00	31.55
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

### 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。



嘉实基金管理有限公司

2023 年 8 月 29 日