

# 国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
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遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>5 托管人报告</b> .....	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	17
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>7 投资组合报告</b> .....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
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.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	57
<b>10 重大事件揭示</b> .....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	59
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	59
<b>12 备查文件目录</b> .....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证新能源汽车 ETF
场内简称	新能车
基金主代码	159806
交易代码	159806
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 10 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	601,696,482.00 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	2020 年 3 月 20 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	1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证新能源汽车指数，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		国泰基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	胡波
	联系电话	021-31081600转	021-61618888
	电子邮箱	xinxipilu@gfund.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95528
传真		021-31081800	021-63602540

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	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码	200082	200001
法定代表人	邱军	郑杨

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a>
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（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	332,271,056.21
本期利润	376,767,784.54
加权平均基金份额本期利润	0.5284
本期加权平均净值利润率	24.87%
本期基金份额净值增长率	27.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	650,465,582.20
期末可供分配基金份额利润	1.0811
期末基金资产净值	1,627,695,816.66
期末基金份额净值	2.7052
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	170.52%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

（2）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

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	11.79%	2.39%	11.92%	2.41%	-0.13%	-0.02%
过去三个月	45.90%	2.23%	45.74%	2.26%	0.16%	-0.03%
过去六个月	27.94%	2.51%	27.36%	2.53%	0.58%	-0.02%
过去一年	122.28%	2.37%	113.15%	2.41%	9.13%	-0.04%
自基金合同生效起至今	170.52%	2.30%	127.01%	2.39%	43.51%	-0.09%

#### 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

国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金  
 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  
 (2020年3月10日至2021年6月30日)



注：本基金的合同生效日为 2020 年 3 月 10 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 179 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利债券型证券投资基金（由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证

食品饮料行业指数证券投资基金（由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价

值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一

年持有期混合型证券投资基金、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金(由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来)、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰核心价值两年持有期股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金。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		
徐成城	国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF) 、国泰中证煤 炭 ETF、国泰 中证钢铁 ETF、国泰中 证全指家用电 器 ETF、国泰 中证新能源汽车 ETF、国泰 中证动漫游戏 ETF、国泰中 证细分机械设 备产业主题 ETF、国泰中 证 800 汽车与 零部件 ETF、 国泰中证细分 机械设备产业 主题 ETF 联 接、国泰中证 有色金属 ETF、国泰中 证动漫游戏 ETF 联接、国 泰中证光伏产 业 ETF、国泰 中证 800 汽车 与零部件 ETF 发起联接、国 泰中证有色金 属 ETF 发起联 接的基金经理	2020-03-1 0	-	15 年	硕士研究生。曾任职于闽发证券。2011 年 11 月加入国泰基金管理有限公司, 历任交易员、基金经理助理。2017 年 2 月至 2021 年 7 月任国泰创业板指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2017 年 2 月至 2020 年 12 月任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理, 2018 年 1 月至 2021 年 7 月任国泰黄金交易型开放式证券投资基金和国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理, 2018 年 4 月至 2018 年 8 月任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2018 年 5 月至 2020 年 12 月任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月至 2019 年 10 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金和国泰国证新能源汽车指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 2018 年 11 月起兼任纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 4 月至 2020 年 12 月任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2020 年 1 月起兼任国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2020 年 1 月至 2021 年 7 月任国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理, 2020 年 2 月起兼任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券

				<p>投资基金的基金经理，2020 年 3 月起兼任国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 4 月至 2021 年 7 月任国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 1 月至 2021 年 7 月任国泰国证房地产行业指数证券投资基金(由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来)的基金经理，2021 年 2 月起兼任国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 4 月起兼任国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 7 月起兼任国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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、组合间同向交易记录配对。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 $\geq 30$ ），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

2021 年上半年，随着疫苗接种率的提高，全球经济逐渐呈现出复苏态势。国内经济也持续维持复苏，出口、投资和消费等主要经济数据均有不错表现。A 股在一季度表现则较弱，呈现先扬后抑的态势：春节前在增量资金和乐观情绪的推动下，热点板块和行业龙头企业股价屡创新高，通胀交易成为市场热点；春节之后，全球货币政策调整的预期已逐渐显现，而美元指数的反弹也吸引着全球热钱加速向美元资产流动；与此同时，国内市场由于部分高价股和热点板块前期涨幅较大，估值显著超越中枢水平，市场整体情绪逐渐趋于理性，A 股随即开始进入调整态势。进入二季度，由于多数大宗商品价格见顶回落，通胀压力有所缓解，通胀交易主题板块的投资热度有所减弱，而较为宽松的流动性也让多数成长板块和核心资产的估值有所修复。从主要指数的表现来看，以科技成长为代表的科创 50 和创业板指数上半年涨幅为 14.01% 和 17.22%，而以大盘蓝筹为代表的上证 50 和沪深 300 则表现一般，半年涨幅为 -3.90% 和 0.24%；分行业来看，上半年申万一级行业中的电气设备、钢铁和化工行业表现居前，而家用电器、非银金融和国防军工等行业则表现居末。

作为完全跟踪标的指数的被动型基金，本基金避免了不必要的主动操作，减少了交易冲击成本，并通过精细化管理确保基金组合与指数权重基本一致。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 27.94%，同期业绩比较基准收益率为 27.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，一方面，随着美联储缩减资产购买规模的时点不断临近，全球股市或将呈现出结构性波动加剧的特征；另一方面，目前变种新冠病毒仍在肆虐，疫苗分配的不平衡和防疫措施的常态化使得全球经济复苏仍有一定的不确定性，各国对于何时退出宽松政策仍无明确时间表。未来流动性宽松或将持续相当一段时间，这将在一定程度上支撑权益市场维持较高的估值水平，但也会导致股市波动率的进一步提升。因此，未来无论是核心资产还是成长风格股票，业绩的重要性将不言而喻。

新能源汽车行业是近期较为热门的投资主题，全球汽车产业在近十年都经历了从无到有的电动化浪潮，我国的新能源汽车产业在政策的大力支持下已初步具备全球竞争力，欧洲市场的新能源汽车也在补贴的刺激下销量不断上升。当前，新能源汽车产业加速趋势依然明显，行业发展空间仍然巨大。一方面，从政策层面上看，国内双积分政策、退补暂缓和欧洲碳排放方案等措施，都会驱动新能源汽车加速发展，而特斯拉、大众 MEB 平台等优质车型的陆续推出，将从供给侧来创造新需求；

另一方面，从发展阶段来看，新能源汽车行业仍处于爆发初期，当前渗透率低，未来 10 年空间巨大。其中动力电池、电机电控等特有零部件、上游材料等需求预料将持续增长；最后，从投资的角度来看，围绕龙头供应链中具备全球竞争力的国内企业进行资产配置，更有望获得超额收益。投资者可积极利用国泰中证新能源汽车 ETF 基金，积极把握行业投资机会。

#### 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的

复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告期内，由国泰基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	12,323,540.48	27,482,660.66
结算备付金		437,682.50	1,951,493.61
存出保证金		771,002.92	624,127.04
交易性金融资产	6.4.7.2	1,615,281,179.16	1,542,658,208.85
其中：股票投资		1,611,342,831.11	1,542,658,208.85
基金投资		-	-
债券投资		3,938,348.05	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		925,345.63	2,102,242.50
应收利息	6.4.7.5	132,769.97	96,751.57
应收股利		91,350.84	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,629,962,871.50</b>	<b>1,574,915,484.23</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	790,307.29
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		637,401.88	489,511.97
应付托管费		127,480.36	97,902.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	571,638.41	263,887.59
应交税费		5,384.51	7,782.05
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	925,149.68	7,103,064.70
<b>负债合计</b>		<b>2,267,054.84</b>	<b>8,752,456.01</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	601,696,482.00	740,696,482.00
未分配利润	6.4.7.10	1,025,999,334.66	825,466,546.22
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,627,695,816.66</b>	<b>1,566,163,028.22</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,629,962,871.50</b>	<b>1,574,915,484.23</b>

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.7052 元，基金份额总额 601,696,482.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 10 日（基 金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>383,344,724.25</b>	<b>186,894,359.74</b>
1.利息收入		2,011,607.90	1,413,650.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	66,964.48	1,413,650.76
债券利息收入		1,811.37	-
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		1,942,832.05	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		336,286,673.89	89,043,220.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	330,919,737.89	84,079,669.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	349,684.62	-
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	5,017,251.38	4,963,551.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	44,496,728.33	96,057,174.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	549,714.13	380,314.12
<b>减：二、费用</b>		<b>6,576,939.71</b>	<b>5,847,491.60</b>
1. 管理人报酬		3,771,270.15	2,212,682.29
2. 托管费		754,253.97	442,536.44
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,708,617.94	2,983,247.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		7,000.46	-
7. 其他费用	6.4.7.19	335,797.19	209,025.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>376,767,784.54</b>	<b>181,046,868.14</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>376,767,784.54</b>	<b>181,046,868.14</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	740,696,482.00	825,466,546.22	1,566,163,028.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	376,767,784.54	376,767,784.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-139,000,000.00	-176,234,996.10	-315,234,996.10
其中：1.基金申购款	627,000,000.00	743,305,103.46	1,370,305,103.46
2.基金赎回款	-766,000,000.00	-919,540,099.56	-1,685,540,099.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	601,696,482.00	1,025,999,334.66	1,627,695,816.66
项目	上年度可比期间		
	2020 年 3 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,360,696,482.00	-	2,360,696,482.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	181,046,868.14	181,046,868.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,762,000,000.00	-51,150,419.15	-1,813,150,419.15
其中：1.基金申购款	229,000,000.00	14,440,004.39	243,440,004.39
2.基金赎回款	-1,991,000,000.00	-65,590,423.54	-2,056,590,423.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	598,696,482.00	129,896,448.99	728,592,930.99

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

国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2020]187 号《关于准予国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,360,662,676.00 元(含募集股票市值)，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(2020)第 0158 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 3 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,360,696,482.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 33,806.00 份基金份额。本基金的基金管理人

为国泰基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[167]号文审核同意，本基金 2,360,696,482.00 份基金份额于 2020 年 3 月 20 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、股指期货、货币市场工具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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准：中证新能源汽车指数收益率。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“国泰中证新能源汽车 ETF 联接基金”)。国泰中证新能源汽车 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 2021 年 8 月 26 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、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 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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 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：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金城市维护建设税、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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	12,323,540.48
定期存款	-
其他存款	-
合计	12,323,540.48

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,222,989,544.28	1,611,342,831.11	388,353,286.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,328,000.00	3,938,348.05
	银行间市场	-	-
	合计	3,328,000.00	3,938,348.05
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,226,317,544.28	1,615,281,179.16	388,963,634.88

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,478.05
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	227.60
应收债券利息	473.38
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	129,243.94
其他	347.00
合计	132,769.97

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	571,638.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	571,638.41

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	109,095.94
应付指数使用费	109,343.90
应付替代款	706,709.84
合计	925,149.68

注：1、应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

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

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	740,696,482.00	740,696,482.00
本期申购	627,000,000.00	627,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-766,000,000.00	-766,000,000.00
本期末	601,696,482.00	601,696,482.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	450,214,155.92	375,252,390.30	825,466,546.22
本期利润	332,271,056.21	44,496,728.33	376,767,784.54
本期基金份额交易产生的变动数	-132,019,629.93	-44,215,366.17	-176,234,996.10
其中：基金申购款	482,557,706.04	260,747,397.42	743,305,103.46
基金赎回款	-614,577,335.97	-304,962,763.59	-919,540,099.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	650,465,582.20	375,533,752.46	1,025,999,334.66

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	51,360.50
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	9,368.04
其他	6,235.94
合计	66,964.48

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	127,267,067.51
股票投资收益——赎回差价收入	203,652,670.38
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	330,919,737.89

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	836,391,374.25
减：卖出股票成本总额	709,124,306.74
买卖股票差价收入	127,267,067.51

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,685,540,099.56
减：现金支付赎回款总额	445,839,326.56
减：赎回股票成本总额	1,036,048,102.62
赎回差价收入	203,652,670.38

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,356,774.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,005,700.00
减：应收利息总额	1,389.73
买卖债券差价收入	349,684.62

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,017,251.38
其中：证券出借权益补偿收入	429,506.22
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,017,251.38

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	44,496,728.33
——股票投资	43,886,380.28
——债券投资	610,348.05
——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	44,496,728.33

注：本基金本会计期间公允价值变动损益——股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	549,714.13
合计	549,714.13

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

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,708,617.94
银行间市场交易费用	-
合计	1,708,617.94

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	425.00
指数使用费	226,276.25
合计	335,797.19

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 0.03% 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 35,000.00 元。当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用基点费的收取下限。

#### 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
国泰基金管理有限公司	基金管理人
国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“国泰中证新能源汽车 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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

本基金本报告期间及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的交易。

###### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年3月10日（基金合同生 效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,771,270.15	2,212,682.29
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司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 X 0.50% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年3月10日（基金合同 生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	754,253.97	442,536.44

注：支付基金托管人浦发银行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 X 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

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

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

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

本基金本报告期内与上年度可比期间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

本基金本报告期内与上年度可比期间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

本基金本报告期与上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

#### 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	206,617,300.00	34.34%	170,917,300.00	23.08%

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年3月10日（基金合同生效

			日)至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	12,323,540.48	51,360.50	9,448,061.58	1,375,943.09

注：本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管，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均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
300450	先导智能	2021-02-04	2021-08-04	大宗交易	89.21	57.87	200,000.00	17,842,000.00	11,574,000.00	-
300450	先导智能	2021-06-03	2021-08-04	送股	-	57.87	120,000.00	-	6,944,400.00	-
688083	中望软件	2021-03-04	2021-09-13	新股锁定	150.50	524.08	1,837.00	276,468.50	962,734.96	-
688819	天能股份	2021-01-07	2021-07-19	新股锁定	41.79	43.69	18,165.00	759,115.35	793,628.85	-
688680	海优新材	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定	69.94	243.61	2,795.00	195,482.30	680,889.95	-
688131	皓元医药	2021-06-01	2021-12-08	新股锁定	64.99	247.10	1,955.00	127,055.45	483,080.50	-
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	新股锁定	28.82	104.16	3,652.00	105,250.64	380,392.32	-
688666	四方	2021-0	2021-0	新股	29.53	129.46	1,687.	49,817	218,39	-

5	光电	2-02	8-09	锁定			00	.11	9.02	
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定	47.33	251.96	663.00	31,379.79	167,049.48	-
688323	瑞华泰	2021-04-21	2021-10-28	新股锁定	5.97	22.78	4,513.00	26,942.61	102,806.14	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	网下中签	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
688113	联测科技	2021-04-26	2021-11-08	新股锁定	19.14	49.29	1,415.00	27,083.10	69,745.35	-
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	17.90	35.97	1,672.00	29,928.80	60,141.84	-
688611	杭州柯林	2021-04-01	2021-10-12	新股锁定	33.44	42.34	1,400.00	46,816.00	59,276.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	网下中签	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
688350	富淼科技	2021-01-21	2021-07-28	新股锁定	13.58	22.44	2,552.00	34,656.16	57,266.88	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	网下中签	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	48.59	90.39	515.00	25,023.85	46,550.85	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	网下中签	8.86	8.86	4,995.00	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	10.64	10.64	3,789.00	40,314.96	40,314.96	-
688597	煜邦电力	2021-06-09	2021-12-17	新股锁定	5.88	10.16	3,907.00	22,973.16	39,695.12	-
688565	力源科技	2021-05-06	2021-11-15	新股锁定	9.39	14.00	2,464.00	23,136.96	34,496.00	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462.00	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	网下中签	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
30098	苏文	2021-0	2021-1	新股	15.83	45.29	317.00	5,018.	14,356	-

2	电能	4-19	0-27	锁定				11	.93	
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股锁定	9.19	40.38	329.00	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新股锁定	8.72	27.11	471.00	4,107.12	12,768.81	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定	18.71	57.62	201.00	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	网下中签	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定	3.40	16.37	576.00	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定	11.72	27.08	340.00	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股锁定	8.24	31.54	286.00	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	4.56	18.88	474.00	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	4.31	13.11	672.00	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股锁定	8.48	22.07	394.00	3,341.12	8,695.58	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	网下中签	6.07	6.07	1,377.00	8,358.39	8,358.39	-
300988	志特	2021-0	2021-1	新股	14.79	30.57	264.00	3,904.	8,070.	-

6	新材	4-21	1-01	锁定				56	48	
30098	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	新股 锁定	6.79	26.81	301.00	2,043. 79	8,069. 81	-
30092	博俊 科技	2020-1 2-29	2021-0 7-12	新股 锁定	10.76	22.20	359.00	3,862. 84	7,969. 80	-
30099	玉马 遮阳	2021-0 5-17	2021-1 1-24	新股 锁定	12.10	19.29	410.00	4,961. 00	7,908. 90	-
30093	屹通 新材	2021-0 1-13	2021-0 7-21	新股 锁定	13.11	24.48	322.00	4,221. 42	7,882. 56	-
30098	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 锁定	24.90	24.81	295.00	7,345. 50	7,318. 95	-
30097	博亚 精工	2021-0 4-07	2021-1 0-15	新股 锁定	18.24	28.29	245.00	4,468. 80	6,931. 05	-
30100	嘉益 股份	2021-0 6-18	2021-1 2-27	新股 锁定	7.81	21.94	312.00	2,436. 72	6,845. 28	-
30099	创益 通	2021-0 5-12	2021-1 1-22	新股 锁定	13.06	26.51	254.00	3,317. 24	6,733. 54	-
30092	江天 化学	2020-1 2-29	2021-0 7-07	新股 锁定	13.39	30.10	217.00	2,905. 63	6,531. 70	-
30101	申菱 环境	2021-0 6-28	2022-0 1-07	新股 锁定	8.29	8.29	782.00	6,482. 78	6,482. 78	-
30097	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股 锁定	5.48	13.03	492.00	2,696. 16	6,410. 76	-
30096	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股 锁定	12.13	22.49	283.00	3,432. 79	6,364. 67	-
30094	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-25	新股 锁定	13.00	27.42	216.00	2,808. 00	5,922. 72	-
30101	华立 科技	2021-0 6-09	2021-1 2-17	新股 锁定	14.20	33.84	175.00	2,485. 00	5,922. 00	-
30094	春晖 智控	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 锁定	9.79	23.01	255.00	2,496. 45	5,867. 55	-
30097	万辰 生物	2021-0 4-08	2021-1 0-19	新股 锁定	7.19	12.65	430.00	3,091. 70	5,439. 50	-
30092	华骐 环保	2021-0 1-12	2021-0 7-21	新股 锁定	13.87	29.55	183.00	2,538. 21	5,407. 65	-
30096	通业 科技	2021-0 3-22	2021-0 9-29	新股 锁定	12.08	23.06	234.00	2,826. 72	5,396. 04	-
30101	漱玉 平民	2021-0 6-23	2022-0 1-05	新股 锁定	8.86	8.86	555.00	4,917. 30	4,917. 30	-
30102	密封 科技	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股 锁定	10.64	10.64	421.00	4,479. 44	4,479. 44	-
30099	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 锁定	14.72	23.32	191.00	2,811. 52	4,454. 12	-
30100	德迈	2021-0	2021-1	新股	5.29	14.44	303.00	1,602.	4,375.	-

7	仕	6-04	2-16	锁定				87	32	
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股锁定	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218.00	1,706.94	3,838.98	-
300948	冠中生态	2021-06-04	2021-08-25	送股	-	27.42	108.00	-	2,961.36	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

#### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127037	银轮转债	2021-06-07	2021-07-09	配债未上市	100.00	100.00	13,585.00	1,358,500.00	1,358,500.00	-

注：1、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》，本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。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金获配的创业板股票如经摇号限售或者比例限售方式锁定的，锁定期限至少为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3、本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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 估值 单价	数量(单位: 股)	期末估值总 额
1	002812	恩捷股份	2021年6月7日 -2021年7月5日	234.1 0	29,600.00	6,929,360.0 0
2	300750	宁德时代	2021年6月7日 -2021年7月5日	534.8 0	11,100.00	5,936,280.0 0
3	002340	格林美	2021年6月29日 -2021年7月13日	9.35	591,600.00	5,531,460.0 0
4	300014	亿纬锂能	2021年6月7日 -2021年7月5日	103.9 3	51,800.00	5,383,574.0 0
5	002460	赣锋锂业	2021年6月7日 -2021年7月5日	121.0 9	40,700.00	4,928,363.0 0
6	002074	国轩高科	2021年6月7日 -2021年7月5日	43.56	111,000.00	4,835,160.0 0
7	002594	比亚迪	2021年6月7日 -2021年7月5日	251.0 0	18,500.00	4,643,500.0 0
8	002709	天赐材料	2021年6月7日 -2021年7月5日	106.5 8	37,000.00	3,943,460.0 0
9	002340	格林美	2021年6月7日 -2021年7月5日	9.35	418,100.00	3,909,235.0 0
10	600885	宏发股份	2021年6月7日 -2021年7月5日	62.70	55,500.00	3,479,850.0 0
11	002050	三花智控	2021年6月7日 -2021年7月5日	23.98	136,900.00	3,282,862.0 0
12	688005	容百科技	2021年6月7日 -2021年7月5日	121.2 0	25,900.00	3,139,080.0 0
13	600733	北汽蓝谷	2021年6月7日 -2021年7月5日	13.48	229,400.00	3,092,312.0 0
14	600884	杉杉股份	2021年6月7日 -2021年7月5日	23.32	125,800.00	2,933,656.0 0
15	300450	先导智能	2021年6月7日 -2021年7月5日	60.14	48,100.00	2,892,734.0 0
16	300124	汇川技术	2021年6月7日	74.26	37,000.00	2,747,620.0

			-2021 年 7 月 5 日			0
17	300037	新宙邦	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	100.1 0	25,900.00	2,592,590.0 0
18	002594	比亚迪	2021 年 6 月 22 日 -2021 年 7 月 6 日	251.0 0	10,000.00	2,510,000.0 0
19	300001	特锐德	2021 年 6 月 22 日 -2021 年 7 月 6 日	30.11	80,000.00	2,408,800.0 0
20	600563	法拉电子	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	158.3 6	14,800.00	2,343,728.0 0
21	600699	均胜电子	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	25.52	88,800.00	2,266,176.0 0
22	300073	当升科技	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	56.19	37,000.00	2,079,030.0 0
23	603659	璞泰来	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	136.6 0	14,800.00	2,021,680.0 0
24	688116	天奈科技	2021 年 6 月 17 日 -2021 年 7 月 1 日	118.0 0	17,000.00	2,006,000.0 0
25	300001	特锐德	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	30.11	66,600.00	2,005,326.0 0
26	688005	容百科技	2021 年 6 月 17 日 -2021 年 7 月 1 日	121.2 0	16,000.00	1,939,200.0 0
27	600066	宇通客车	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	12.49	144,300.00	1,802,307.0 0
28	600885	宏发股份	2021 年 6 月 17 日 -2021 年 7 月 1 日	62.70	28,000.00	1,755,600.0 0
29	688116	天奈科技	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	118.0 0	14,800.00	1,746,400.0 0
30	688388	嘉元科技	2021 年 6 月 17 日 -2021 年 7 月 1 日	90.96	19,000.00	1,728,240.0 0
31	688116	天奈科技	2021 年 6 月 17 日 -2021 年 7 月 1 日	118.0 0	14,300.00	1,687,400.0 0
32	600733	北汽蓝谷	2021 年 6 月 17 日 -2021 年 7 月 1 日	13.48	100,000.00	1,348,000.0 0
33	600733	北汽蓝谷	2021 年 6 月 17 日 -2021 年 7 月 1 日	13.48	100,000.00	1,348,000.0 0
34	600733	北汽蓝谷	2021 年 6 月 17 日 -2021 年 7 月 1 日	13.48	100,000.00	1,348,000.0 0
35	688006	杭可科技	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	85.00	14,800.00	1,258,000.0 0
36	300618	寒锐钴业	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	78.84	14,800.00	1,166,832.0 0
37	688388	嘉元科技	2021 年 6 月 7 日 -2021 年 7 月 5 日	90.96	11,100.00	1,009,656.0 0
38	688006	杭可科技	2021 年 6 月 17 日	85.00	10,000.00	850,000.00

			-2021 年 7 月 1 日			
39	600733	北汽蓝谷	2021 年 6 月 29 日 -2021 年 7 月 27 日	13.48	60,000.00	808,800.00
40	300001	特锐德	2021 年 6 月 22 日 -2021 年 7 月 6 日	30.11	15,000.00	451,650.00
合计	-	-	-	-	2,985,000.00	108,089,921.00

### 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

本基金属于股票型基金，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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证新能源汽车指数，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。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。

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、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、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浦发银行，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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.24%(2020 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来自调整基金投资组合时，由于部分成分股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2021 年 6 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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 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%。

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 2021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	12,323,540.48	-	-	-	12,323,540.48
结算备付金	437,682.50	-	-	-	437,682.50
存出保证金	771,002.92	-	-	-	771,002.92
交易性金融资产	-	-	3,938,348.05	1,611,342,831.11	1,615,281,179.16
应收证券清算款	-	-	-	925,345.63	925,345.63
应收股利	-	-	-	91,350.84	91,350.84
应收利息	-	-	-	132,769.97	132,769.97
资产总计	13,532,225.90	-	3,938,348.05	1,612,492,297.55	1,629,962,871.40

					50
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	637,401.88	637,401.88
应付托管费	-	-	-	127,480.36	127,480.36
应付交易费用	-	-	-	571,638.41	571,638.41
应交税费	-	-	-	5,384.51	5,384.51
其他负债	-	-	-	925,149.68	925,149.68
负债总计	-	-	-	2,267,054.84	2,267,054.84
利率敏感度缺口	13,532,225.90	-	3,938,348.05	1,610,225,242.71	1,627,695,816.66
上年度末 2020 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	27,482,660.66	-	-	-	27,482,660.66
结算备付金	1,951,493.61	-	-	-	1,951,493.61
存出保证金	624,127.04	-	-	-	624,127.04
交易性金融资产	-	-	-	1,542,658,208.85	1,542,658,208.85
应收证券清算款	-	-	-	2,102,242.50	2,102,242.50
应收利息	-	-	-	96,751.57	96,751.57
资产总计	30,058,281.31	-	-	1,544,857,202.92	1,574,915,484.23
负债					
应付证券清算款	-	-	-	790,307.29	790,307.29
应付管理人报酬	-	-	-	489,511.97	489,511.97
应付托管费	-	-	-	97,902.41	97,902.41
应付交易费用	-	-	-	263,887.59	263,887.59
应交税费	-	-	-	7,782.05	7,782.05
其他负债	-	-	-	7,103,064.70	7,103,064.70
负债总计	-	-	-	8,752,456.01	8,752,456.01
利率敏感度缺口	30,058,281.31	-	-	1,536,104,746.91	1,566,163,028.22

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.24%(2020 年 12 月 31 日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金主要投资于标的指数成份股。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，本基金的基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。

本基金所持有的股票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，权证投资不高于基金资产净值的 3%。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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,611,342,831.11	99.00	1,542,658,208.85	98.50
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	1,611,342,831.11	99.00	1,542,658,208.85	98.50

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证新能源汽车指数外其他市场变量不变		
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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	中证新能源汽车指数收益率上升 5%	增加约 8,072	-
	中证新能源汽车指数收益率下降 5%	减少约 8,072	-

注: 于 2020 年 12 月 31 日, 本基金成立尚未满一年, 无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,590,331,679.10 元，属于第二层次的余额为 24,949,500.06 元，无属于第三层次的余额。（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,539,257,657.19 元，第二层次的余额为 3,397,161.66 元，无属于第三层次的余额。）

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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。（2020 年 12 月 31 日：无）

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 基金申购款

于 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 1,370,305,103.46 元，其中包括以股票支付的申购款 998,212,480.08 元和以现金支付的申购款 372,092,623.38 元。

(3) 除公允价值、基金申购款外，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	1,611,342,831.11	98.86
	其中：股票	1,611,342,831.11	98.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,938,348.05	0.24
	其中：债券	3,938,348.05	0.24
	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	12,761,222.98	0.78
8	其他各项资产	1,920,469.36	0.12
9	合计	1,629,962,871.50	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 108,089,921.00 元，占基金资产净值比例为 6.64%。

## 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	1,606,145,642.07	98.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,606,145,642.07	98.68

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,440,297.61	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
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	1,028,912.66	0.06
J	金融业	34,721.10	0.00
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	483,080.50	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	70,768.33	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,197,189.04	0.32

### 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	300750	宁德时代	347,618	185,906,106.40	11.42
2	002594	比亚迪	691,660	173,606,660.00	10.67
3	300014	亿纬锂能	1,117,653	116,157,676.29	7.14
4	300124	汇川技术	1,551,656	115,225,974.56	7.08

5	002812	恩捷股份	480,456	112,474,749.60	6.91
6	002460	赣锋锂业	826,101	100,032,570.09	6.15
7	002709	天赐材料	597,920	63,726,313.60	3.92
8	300450	先导智能	1,002,060	59,537,488.40	3.66
9	002074	国轩高科	1,120,800	48,822,048.00	3.00
10	002340	格林美	5,018,300	46,921,105.00	2.88
11	002050	三花智控	1,875,926	44,984,705.48	2.76
12	688005	容百科技	303,400	36,772,080.00	2.26
13	600885	宏发股份	555,025	34,800,067.50	2.14
14	600733	北汽蓝谷	2,416,100	32,569,028.00	2.00
15	603659	璞泰来	236,820	32,349,612.00	1.99
16	300037	新宙邦	306,400	30,670,640.00	1.88
17	600884	杉杉股份	1,235,830	28,819,555.60	1.77
18	603026	石大胜华	166,500	26,981,325.00	1.66
19	002407	多氟多	650,100	23,104,554.00	1.42
20	300568	星源材质	538,365	22,272,160.05	1.37
21	600699	均胜电子	865,880	22,097,257.60	1.36
22	688116	天奈科技	181,300	21,393,400.00	1.31
23	300073	当升科技	373,600	20,992,584.00	1.29
24	300001	特锐德	683,700	20,586,207.00	1.26
25	600563	法拉电子	125,800	19,921,688.00	1.22
26	300618	寒锐钴业	239,200	18,858,528.00	1.16
27	600066	宇通客车	1,420,850	17,746,416.50	1.09
28	600549	厦门钨业	832,500	17,340,975.00	1.07
29	688388	嘉元科技	177,600	16,154,496.00	0.99
30	600110	诺德股份	1,054,500	12,843,810.00	0.79
31	300035	中科电气	504,900	12,344,805.00	0.76
32	300769	德方纳米	56,100	11,595,309.00	0.71
33	688006	杭可科技	125,800	10,693,000.00	0.66
34	002850	科达利	112,200	9,806,280.00	0.60
35	300919	中伟股份	56,110	9,145,930.00	0.56
36	002126	银轮股份	785,400	8,168,160.00	0.50
37	300409	道氏技术	336,600	8,004,348.00	0.49
38	300432	富临精工	448,800	6,238,320.00	0.38
39	300890	翔丰华	56,144	3,065,462.40	0.19
40	002227	奥特迅	112,200	1,989,306.00	0.12
41	300742	越博动力	56,100	1,424,940.00	0.09

### 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	688083	中望软件	1,837	962,734.96	0.06
2	688819	天能股份	18,165	793,628.85	0.05
3	688680	海优新材	2,795	680,889.95	0.04
4	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.03
5	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.02
6	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.01
7	300957	贝泰妮	663	167,049.48	0.01
8	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.01
9	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
10	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
11	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.00
12	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
13	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.00
14	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.00
15	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.00
16	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
17	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
18	300981	中红医疗	515	46,550.85	0.00
19	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
20	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
21	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.00
22	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
23	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
24	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
25	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
26	1207	联科科技	682	22,581.02	0.00
27	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
28	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
29	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
30	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
31	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
32	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
33	1208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
34	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
35	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
36	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
37	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
38	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
39	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
40	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
41	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
42	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
43	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
44	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00

45	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
46	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
47	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
48	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
49	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
50	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
51	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
52	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
53	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
54	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
55	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
56	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
57	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
58	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
59	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
60	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
61	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
62	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
63	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
64	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
65	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
66	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
67	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
68	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
69	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
70	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
71	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
72	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
73	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
74	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
75	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
76	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
77	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
78	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
79	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
80	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
81	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	002594	比亚迪	94,103,782.40	6.01
2	300750	宁德时代	78,428,706.00	5.01
3	600885	宏发股份	51,746,206.30	3.30
4	300124	汇川技术	44,025,888.12	2.81
5	600733	北汽蓝谷	41,087,848.89	2.62
6	600699	均胜电子	34,881,002.08	2.23
7	600884	杉杉股份	34,786,381.17	2.22
8	600066	宇通客车	34,615,709.41	2.21
9	300014	亿纬锂能	32,590,470.09	2.08
10	603659	璞泰来	28,471,970.60	1.82
11	688005	容百科技	28,188,390.37	1.80
12	600563	法拉电子	26,624,468.53	1.70
13	002407	多氟多	24,772,166.00	1.58
14	002460	赣锋锂业	23,045,313.40	1.47
15	603026	石大胜华	21,924,547.20	1.40
16	600549	厦门钨业	20,652,103.80	1.32
17	300450	先导智能	18,786,704.00	1.20
18	688006	杭可科技	18,722,798.89	1.20
19	688116	天奈科技	17,107,717.29	1.09
20	688388	嘉元科技	16,461,664.83	1.05

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	600885	宏发股份	84,846,398.89	5.42
2	600733	北汽蓝谷	75,633,944.08	4.83
3	600884	杉杉股份	60,007,524.15	3.83
4	600066	宇通客车	55,068,312.98	3.52
5	600699	均胜电子	51,051,328.67	3.26
6	600563	法拉电子	48,452,902.50	3.09
7	688005	容百科技	48,291,549.75	3.08
8	603659	璞泰来	47,233,261.00	3.02
9	002709	天赐材料	44,293,632.08	2.83
10	300450	先导智能	36,330,736.80	2.32
11	688006	杭可科技	31,533,260.07	2.01
12	002074	国轩高科	28,240,889.09	1.80
13	688116	天奈科技	26,196,738.32	1.67

14	002340	格林美	19,409,887.00	1.24
15	002056	横店东磁	19,277,916.00	1.23
16	688388	嘉元科技	18,928,406.26	1.21
17	300568	星源材质	15,769,368.68	1.01
18	300073	当升科技	15,197,948.88	0.97
19	000970	中科三环	14,707,525.63	0.94
20	300001	特锐德	12,817,658.78	0.82

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	771,758,171.26
卖出股票的收入（成交）总额	836,391,374.25

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,938,348.05	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,938,348.05	0.24

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127036	三花转债	19,695	2,579,848.05	0.16
2	127037	银轮转债	13,585	1,358,500.00	0.08

## 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股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“国轩高科”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。

国轩高科公司自身因业绩预测结果不准确或不及时，未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责等原因，受到当地证监局责令改正等监管处罚。

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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	771,002.92
2	应收证券清算款	925,345.63
3	应收股利	91,350.84
4	应收利息	132,769.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,920,469.36

#### 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

##### 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	300450	先导智能	18,518,400.00	1.14	大宗受限
2	002340	格林美	9,440,695.00	0.58	转融通证券 出借业务的 股票
3	002594	比亚迪	7,153,500.00	0.44	转融通证券 出借业务的 股票
4	002812	恩捷股份	6,929,360.00	0.43	转融通证券 出借业务的 股票
5	300750	宁德时代	5,936,280.00	0.36	转融通证券 出借业务的 股票
6	300014	亿纬锂能	5,383,574.00	0.33	转融通证券 出借业务的 股票
7	002460	赣锋锂业	4,928,363.00	0.30	转融通证券

					出借业务的股票
8	002074	国轩高科	4,835,160.00	0.30	转融通证券出借业务的股票
9	002709	天赐材料	3,943,460.00	0.24	转融通证券出借业务的股票
10	300450	先导智能	2,892,734.00	0.18	转融通证券出借业务的股票
11	300124	汇川技术	2,747,620.00	0.17	转融通证券出借业务的股票

#### 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	688083	中望软件	962,734.96	0.06	新股锁定
2	688819	天能股份	793,628.85	0.05	新股锁定
3	688680	海优新材	680,889.95	0.04	新股锁定
4	688131	皓元医药	483,080.50	0.03	新股锁定
5	688626	翔宇医疗	380,392.32	0.02	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

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		新能源汽车 ETF 联接	
		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
18,450	32,612.28	158,469,313.00	26.34%	236,609,869.00	39.32%	206,617,300.00	34.34%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	117,999,901.00	19.61%
2	国寿投资控股有限公司	8,801,400.00	1.46%
3	方正证券股份有限公司	5,838,977.00	0.97%
4	张磊	4,030,900.00	0.67%
5	中国人寿资管—工商银行—国寿资产—FOF 优选灵活 1 号保险资产管理产品	3,999,901.00	0.66%
6	中信证券股份有限公司	3,486,444.00	0.58%
7	冯同保	2,708,800.00	0.45%
8	毛巧巧	2,600,007.00	0.43%
9	中信建投证券股份有限公司	2,503,501.00	0.42%
10	杨国平	2,100,145.00	0.35%
-	国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	206,617,300.00	34.34%

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	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	0.00	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的情况

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

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 3 月 10 日）基金份额总额	2,360,696,482.00
本报告期期初基金份额总额	740,696,482.00
本报告期基金总申购份额	627,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	766,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	601,696,482.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，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，本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 3 月 31 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告》，经本基金管理人第八届董事会第四次会议审议通过，张玮先生担任本基金管理人副总经理。

2021 年 4 月 1 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司董事变更公告》，经本基金管理人股东会审议通过，对本基金管理人董事会成员进行了调整。

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，本基金根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》修改基金合同，涉及投资策略变更，详见基金合同。修订后的投资策略也可参阅本报告 2.2 基金产品说明。

### 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

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	949,224,054.20	59.40%	105,653.09	15.12%	-
海通证券	1	564,288,417.93	35.31%	525,783.91	75.22%	-
西部证券	1	50,366,882.41	3.15%	35,825.91	5.13%	-
中信建投	1	22,989,272.27	1.44%	21,409.85	3.06%	-
上海证券	1	4,290,006.25	0.27%	3,995.33	0.57%	-
东吴证券	1	3,555,350.81	0.22%	3,311.11	0.47%	-
国泰君安	1	2,618,371.19	0.16%	2,386.20	0.34%	-
中信证券	1	627,254.32	0.04%	584.16	0.08%	-
华西证券	1	35,868.00	0.00%	25.50	0.00%	-

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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	2,443,634.35	72.80%	-	-	-	-
上海证券	913,140.00	27.20%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

## 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	国泰基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式基金流动性服务商的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2021-01-20
2	国泰基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式基金流动性服务商的公告	《中国证券报》、《上海证券报》	2021-01-21
3	国泰基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
4	国泰基金管理有限公司高级管理人员任职公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2021-03-31
5	国泰基金管理有限公司董事变更公告	《中国证券报》	2021-04-01

## 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
国泰中	1	2021年01月01	170,91	171,70	136,000,	206,617,300	34.34%

证新能 源汽车 交易型 开放式 指数证 券投资 基金发 起式联 接基金		日至 2021 年 06 月 30 日	7,300. 00	0,000. 00	000.00	.00	
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 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

### 12.2 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。

### 12.3 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>

国泰基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日