

广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 广发国证新能源车电池 ETF |
| 场内简称 | 电池 ETF |
| 基金主代码 | 159755 |
| 交易代码 | 159755 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 6 月 15 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,474,646,746.00 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成 |

| | |
|--------|---|
| | 份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。 具体包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、股指期货投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。 |
| 业绩比较基准 | 国证新能源车电池指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、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。 |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日) |
|----------------|--|
| 1.本期已实现收益 | 74,907,599.78 |
| 2.本期利润 | -2,438,890.54 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0020 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,861,143,147.96 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2621 |

注：(1) 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。

(2) 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。

3.2 基金净值表现

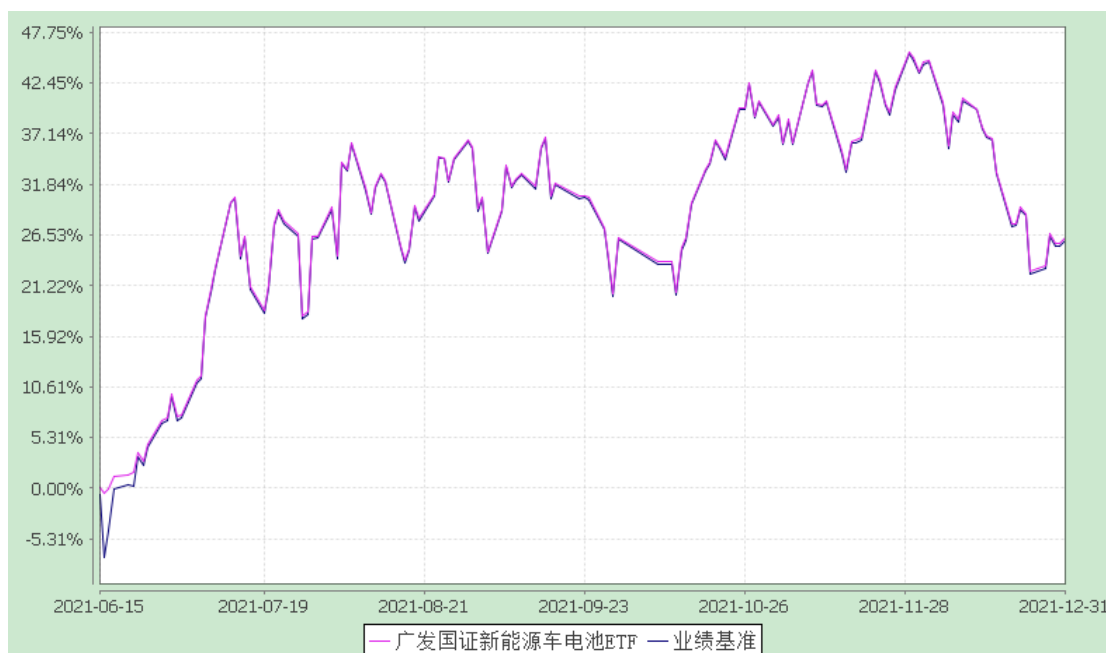
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -0.07% | 2.11% | -0.09% | 2.13% | 0.02% | -0.02% |
| 过去六个月 | 14.83% | 2.63% | 14.92% | 2.65% | -0.09% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 26.21% | 2.54% | 25.95% | 2.67% | 0.26% | -0.13% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 6 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日)



注：（1）本基金合同生效日期为 2021 年 6 月 15 日，至披露时点未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经 理期限 | | 证券从业 年限 | 说明 |
|---------|---|-----------------|----------|------------|--|
| | | 任职日 期 | 离任日 期 | | |
| 罗国 庆 | 本基金的基金 经理；广发中 证医疗指数证 券投资基金 (LOF) 的基金 经理；广发 中证传媒交易 型开放式指数 证券投资基金 的基金经理； 广发中证传媒 | 2021-06- 15 | - | 12 年 | 罗国庆先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|---|
| | <p>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；广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 100 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；广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证创新药产业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；广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发国证新能源车电池交易型开放式指数</p> | | | | <p>13 日至 2020 年 5 月 25 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 8 月 25 日)、广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 11 月 30 日)、广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 7 月 31 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 9 月 13 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 11 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2020 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 17 日)。</p> |
|--|---|--|--|--|---|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | 证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证沪港深科技龙头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；指数投资部副总经理 | | | | |
|--|--|--|--|--|--|

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 1 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年第 4 季度，沪深 300 指数上涨 1.52%，中证 500 指数上涨 3.60%，创业板指数上涨 2.40%。经过第 3 季度的宽幅震荡，A 股市场在第 4 季度整体企稳，但结构分化仍然明显，中小盘成长风格总体强于大盘价值风格。行业板块的分化很大程度上来源于政策的影响：工业上游原材料板块在国家稳定原材料价格的政策预期下冲高回落；地产链、互联网板块产业政策趋严也使得行业估值整体受到压制；相反，受政策扶持的先进制造、新能源以及农业板块整体表现较好。

国证新能源车电池指数是为了反映 A 股市场中新能源车电池产业上市公司表现而编制的，成份股的业务领域主要涉及新能源车电池、电池管理及充电桩业务等。作为 ETF 基金，本基金秉承指数化被动投资策略，按照根据指数结构复制指数的方法投资，指数样本采用完全复制方法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

2021 年第 4 季度，国证新能源车电池指数下跌 0.09%，但电池行业仍然保持较高的景气度。一方面受益于新能源车渗透率的持续提升，另一方面受益于锂电在储能领域应用场景的不断拓展，我国电池产业持续增长。在市场景气度较高的背景下，电池厂及中游材料环节不断扩张产能，电池厂的成本压力逐步缓解和转移，受益于毛利提升叠加装机量的进一步增长，明年电池行业或将继续维持较高的景气度。

基金投资运作方面，报告期内，本基金严格遵守合同要求，认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作，运作过程中未发生任何风险事件。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-0.07%，同期业绩比较基准收益率为-0.09%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,853,312,767.78 | 99.28 |
| | 其中：普通股 | 1,853,312,767.78 | 99.28 |
| | 存托凭证 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 11,881,920.97 | 0.64 |
| 7 | 其他资产 | 1,520,449.21 | 0.08 |
| 8 | 合计 | 1,866,715,137.96 | 100.00 |

注：（1）上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 44,336,561.00 元，占基金资产净值比例 2.38%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 27,500,695.00 | 1.48 |
| C | 制造业 | 1,791,328,877.96 | 96.25 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 11,519.99 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 26,545.52 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,115,283.51 | 0.11 |
| 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 | 131,216.33 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,452.32 | 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 | 18,161.78 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 32,168,207.37 | 1.73 |
| | 合计 | 1,853,311,567.78 | 99.58 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 300750 | 宁德时代 | 467,401 | 274,831,788.00 | 14.77 |
| 2 | 002594 | 比亚迪 | 887,639 | 237,993,768.68 | 12.79 |
| 3 | 300014 | 亿纬锂能 | 1,307,259 | 154,491,868.62 | 8.30 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|----------------|------|
| 4 | 002812 | 恩捷股份 | 514,313 | 128,783,975.20 | 6.92 |
| 5 | 002460 | 赣锋锂业 | 839,649 | 119,943,859.65 | 6.44 |
| 6 | 603799 | 华友钴业 | 1,016,545 | 112,135,078.95 | 6.03 |
| 7 | 300450 | 先导智能 | 1,042,080 | 77,499,489.60 | 4.16 |
| 8 | 002709 | 天赐材料 | 599,700 | 68,755,605.00 | 3.69 |
| 9 | 002074 | 国轩高科 | 1,138,580 | 58,352,225.00 | 3.14 |
| 10 | 603659 | 璞泰来 | 328,321 | 52,731,635.81 | 2.83 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股

票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 831,900.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | 612,552.66 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 75,995.64 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,520,449.21 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 (元) | 占基金资产 净值比例(%) | 流通受限 情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 23,520,000.00 | 1.26 | 转融通流 通受限 |
| 2 | 002594 | 比亚迪 | 3,726,868.00 | 0.20 | 转融通流 通受限 |
| 3 | 603799 | 华友钴业 | 2,912,184.00 | 0.16 | 转融通流 通受限 |
| 4 | 002812 | 恩捷股份 | 2,504,000.00 | 0.13 | 转融通流 通受限 |
| 5 | 002709 | 天赐材料 | 1,318,475.00 | 0.07 | 转融通流 通受限 |
| 6 | 002074 | 国轩高科 | 989,125.00 | 0.05 | 转融通流 通受限 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,284,646,746.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,441,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,251,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,474,646,746.00 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 |
| 广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资 | 1 | 20211122-20211123,20211126-20211130,20211202-20211205,20211208-20211213 | 191,599,906.00 | 122,800,000.00 | 31,200,000.00 | 283,199,906.00 | 19.20% |

| | | | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 资基金 发起式 联接基 金 | | | | | | | |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>① 当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>② 在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>④ 在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p> | | | | | | | |

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一) 中国证监会批准广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

(二) 《广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三) 《广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四) 法律意见书

9.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

9.3 查阅方式

1. 书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇二二年一月二十一日