

# 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式 指数证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 28 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 24 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人和本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 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                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 4.9 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       | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 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 | 16        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 16        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>18</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 18        |
| 7.2 利润表                                 | 19        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 20        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |

|                                              |           |
|----------------------------------------------|-----------|
| <b>§8 投资组合报告</b>                             | <b>40</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                               | 40        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                         | 40        |
| 8.3 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            | 42        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                          | 44        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                         | 45        |
| 8.6 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           | 45        |
| 8.7 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        | 46        |
| 8.8 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        | 46        |
| 8.9 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           | 46        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明                    | 46        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明                    | 46        |
| 8.12 投资组合报告附注                                | 46        |
| <b>§9 基金份额持有人信息</b>                          | <b>47</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                        | 47        |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人                             | 47        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                     | 48        |
| 9.4 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             | 48        |
| 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 | 48        |
| <b>§10 开放式基金份额变动</b>                         | <b>48</b> |
| <b>§11 重大事件揭示</b>                            | <b>48</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议                             | 48        |
| 11.2 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             | 48        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼                  | 49        |
| 11.4 基金投资策略的改变                               | 49        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况                        | 49        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况                | 49        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况                       | 49        |
| 11.8 其他重大事件                                  | 50        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b>                    | <b>53</b> |
| 12.1 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           | 53        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息                          | 53        |
| <b>§13 备查文件目录</b>                            | <b>53</b> |
| 13.1 备查文件目录                                  | 53        |
| 13.2 存放地点                                    | 54        |
| 13.3 查阅方式                                    | 54        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                            |
|--------------|----------------------------|
| 基金名称         | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 景顺长城国证新能源车电池 ETF           |
| 场内简称         | 电池 30ETF                   |
| 基金主代码        | 159757                     |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                     |
| 基金合同生效日      | 2021 年 7 月 21 日            |
| 基金管理人        | 景顺长城基金管理有限公司               |
| 基金托管人        | 华夏银行股份有限公司                 |
| 报告期末基金份额总额   | 406,931,891.00 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         | 2021 年 8 月 9 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最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资策略 | <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金以国证新能源车电池指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使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%。</p> <p>2、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>3、股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人期权投资管理从其最新规定，</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>以符合上述法律法规和监管要求的变化。未来如法律法规或监管机构允许基金投资其他期权品种，本基金将在履行适当程序后，纳入投资范围并制定相应投资策略。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>5、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>6、可转换债券投资策略和可交换债券投资策略</p> <p>A) 相对价值分析：基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券和可交换债券的股性和债性的相对价值。通过对可转换债券和可交换债券的转股溢价率和 Delta 系数的度量，筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。</p> <p>B) 基本面研究：基金管理人依据内、外部研究成果，运用景顺长城股票研究数据库（SRD）对可转换债券和可交换债券标的公司进行多方位、多角度的分析，重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的标的公司。</p> <p>C) 估值分析：在基本面分析的基础上，运用 PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG 等相对估值指标以及 DCF、DDM 等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估，并根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算可转换债券和可交换债券当前的理论价格和未来目标价格，进行投资决策。</p> <p>7、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。</p> |
| 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，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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          |      | 景顺长城基金管理有限公司       | 华夏银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 杨皞阳                | 郑鹏                   |
|             | 联系电话 | 0755-82370388      | (010) 85238667       |
|             | 电子邮箱 | investor@igwfm.com | zhengpeng@hxb.com.cn |

|        |                              |                            |
|--------|------------------------------|----------------------------|
| 客户服务电话 | 4008888606                   | 95577                      |
| 传真     | 0755-22381339                | (010) 85238680             |
| 注册地址   | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005) |
| 办公地址   | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市东城区建国门内大街 22 号 (100005) |
| 邮政编码   | 518048                       | 100005                     |
| 法定代表人  | 李进                           | 李民吉                        |

## 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         |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人的办公场所    |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                         |
|--------|----------------------|------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼  |
| 注册登记机构 | 景顺长城基金管理有限公司         | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 |

# §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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 | 2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 61,068,507.08                             |
| 本期利润          | 42,160,457.16                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0900                                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 8.71%                                     |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.33%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末                                   |
| 期末可供分配利润      | -1,329,418.62                             |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0033                                   |
| 期末基金资产净值      | 405,602,472.38                            |
| 期末基金份额净值      | 0.9967                                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末                                   |
| 基金份额累计净值增长率   | -0.33%                                    |

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、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、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。

4、本基金基金合同生效日为 2021 年 7 月 21 日。

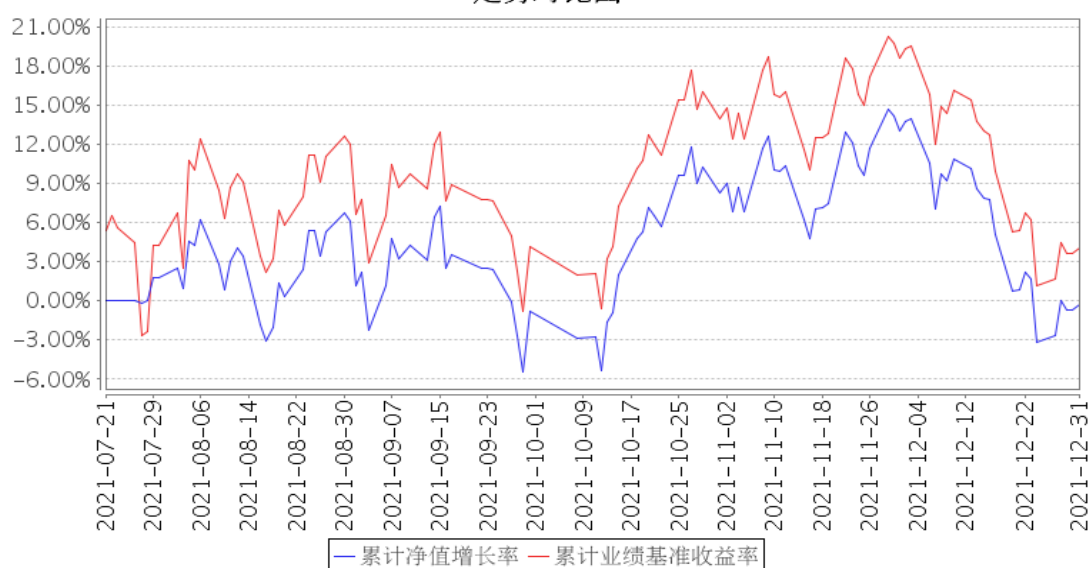
## 3.2 基金净值表现

### 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.51%    | 2.09%       | -0.09%     | 2.13%         | 0.60%  | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.33%   | 2.17%       | 4.06%      | 2.58%         | -4.39% | -0.41% |

### 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

景顺长城国证新能源车电池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

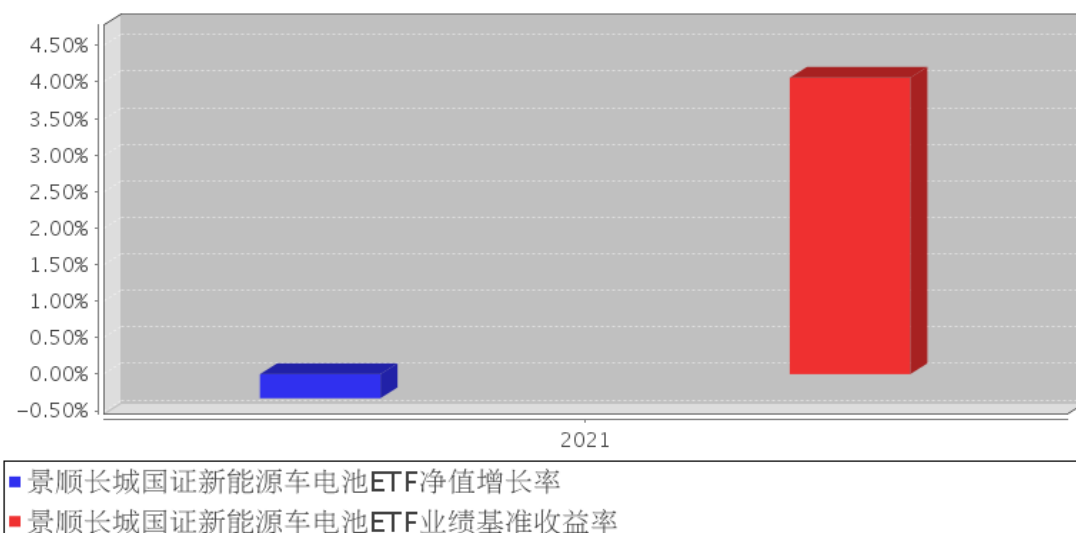


注：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的建仓期为自 2021 年 7 月 21 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2021 年 7 月 21 日）起至本报告期末不满一年。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城国证新能源车电池ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2021 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2021年7月21日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

## §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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2021年12月31日，本公司旗下共管理140只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产

配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 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 |        |                                                                                                                                     |
| 张 晓 南 | 本基金的基金经理 | 2021 年 7 月 21 日 | -    | 11 年   | 经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 投资部基金经理。具有 11 年证券、基金行业从业经验。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理

公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的交易指令。

#### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，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 25 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现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 12 月工业增加值当月同比增长 4.30%，前值 3.80%，整体表现较为低迷；当月环比增长 0.42%，相比之前略有好转，仍然处于后疫情时代复苏区间。12 月 PMI 指数为 50.30，维持在 50 以上，相较前两个月有所回暖。12 月 PPI 同比增长 10.30%，前值 12.90%，环比增长-1.20%；CPI 同比增长 1.50%，前值 2.30%，环比增长-0.30%，经济增长预期略有下降。12 月 M2 同比增长 9.00%，M1 同比增长 3.50%，社会融资规模存量同比增长 10.30%，增速逐渐降低至均衡水平。12 月末外汇储备 3.25 万亿美元，再创近期新高。2021 年全年行情震荡，风格转换较为频繁，截至 2021 年底，上证综指、深证成指、沪深 300、中证 500、创业板指和科创 50 的收益率分别为 4.80%、2.67%、-5.20%、15.58%、12.02%和 0.37%。就全年行情来看，在去年四季度市场回暖后，一季度多数板块有所回调，二季度以芯片及新能源车为代表的科技板块显示出明显的盈利驱动复苏态势，三季度更多的是中小企业盈利增速复苏叠加专精特新“小巨人”等政策刺激有所表现，其他板块出现获利回吐，四季度市场回暖，但中小企业仍保持强势，中小市值企业占比较高的中证 500 和深证成指表现优异。

由于新的新冠病毒变种 Omicron 的出现，美国每日新增确诊接近 100 万人，拜登政府上台后累计死亡人数已经超过 40 万人；法国每日新增确诊超过 40 万人；日本也再次出现爆发，单日新增确诊最高超过 5 万人。Omicron 较高的传染性、较长的潜伏期令疫情防控难度再次增加，虽然

症状较 Delta 为轻，免疫能力较弱的老人与小孩仍面临巨大的威胁。同时新的变种令现有疫苗的保护率有所下降，对当前疫苗接种率较高的国家的防疫工作提出了挑战。

国内当前也出现了零星的疫情复发，在“动态清零”的防疫政策下，当前已经基本得到了控制。国内经济目前仍然能够受益于全球其它国家经济活动的低迷，在全球主要经济体经济增长停滞甚至衰退的形势下，国内生产厂商在国内疫情结束较早、生产恢复较快的情形下，相当大一部分的填补了国内外需求缺口，且在国外尚未完全走出疫情影响前，这一趋势并不会发生转变。而在全球经济摆脱疫情影响后，国内生产厂商在全球供应链中的地位也会有所提高。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至本报告期末，本基金份额净值增长率为-0.33%，业绩比较基准收益率为 4.06%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度为 0.3%，跟踪误差（年化）为 17.16%，由于建仓期因素，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标超出合同规定范围。预计正常运作后，将恢复至合理范围。

#### 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 2022 年，疫情短时间内无法得到有效控制，目前变异毒株的快速传播可能令后续疫情形势发生变化。在全球疫苗接种率逐渐提高，同时各国医疗资源充沛后可能将疫情压制到较低水平，并开始真正的全球经济复苏。全球产能恢复的速度在当前时点无法明确预见，而“中国制造”为全球工业品和消费品的生产做出了卓越的贡献，也为国内经济增长提供了坚实的基础。2021 年 12 月的中央经济工作会议提出要“全面实行股票发行注册制”，预计后续相关政策将陆续出台。在整体经济复苏加快的基础上，资本市场仍有强大的吸引力，我们对市场保持乐观。当前继续看好成长板块在全球经济复苏阶段的表现，后续成长性高、现金流好、行业竞争格局稳定且公司地位明确的股票更有优势。

本基金采用完全复制国证新能源车电池的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况，根据指数成份股及其权重变化定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后继教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持

有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同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，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，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。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

#### 4.9 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

**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**

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

**5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

**§6 审计报告****6.1 审计报告基本信息**

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2022)第 24438 号 |

**6.2 审计报告的基本内容**

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题    | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 审计报告收件人   | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 审计意见      | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“景顺长城国证新能源车电池 ETF”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了景顺长城国证新能源车电池 ETF2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城国证新能源车电池 ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                |



|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>景顺长城国证新能源车电池 ETF 的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城国证新能源车电池 ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城国证新能源车电池 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城国证新能源车电池 ETF 的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对景顺长城国证新能源车电池 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致景顺长城国证新能源车电池 ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出</p> |

|           |                      |     |
|-----------|----------------------|-----|
|           | 的值得关注的内部控制缺陷。        |     |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |     |
| 注册会计师的姓名  | 单峰                   | 郭劲扬 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市                |     |
| 审计报告日期    | 2022 年 3 月 24 日      |     |

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                         |
| 银行存款        | 7.4.7.1 | 4,747,534.77            |
| 结算备付金       |         | 288,502.82              |
| 存出保证金       |         | 782,630.54              |
| 交易性金融资产     | 7.4.7.2 | 401,096,525.96          |
| 其中：股票投资     |         | 401,096,525.96          |
| 基金投资        |         | —                       |
| 债券投资        |         | —                       |
| 资产支持证券投资    |         | —                       |
| 贵金属投资       |         | —                       |
| 衍生金融资产      | 7.4.7.3 | —                       |
| 买入返售金融资产    | 7.4.7.4 | —                       |
| 应收证券清算款     |         | 364,788.16              |
| 应收利息        | 7.4.7.5 | 1,150.90                |
| 应收股利        |         | —                       |
| 应收申购款       |         | —                       |
| 递延所得税资产     |         | —                       |
| 其他资产        | 7.4.7.6 | —                       |
| 资产总计        |         | 407,281,133.15          |
| 负债和所有者权益    | 附注号     | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
| <b>负 债：</b> |         |                         |
| 短期借款        |         | —                       |
| 交易性金融负债     |         | —                       |
| 衍生金融负债      | 7.4.7.3 | —                       |
| 卖出回购金融资产款   |         | —                       |
| 应付证券清算款     |         | 87,068.02               |
| 应付赎回款       |         | —                       |
| 应付管理人报酬     |         | 146,030.41              |

|               |          |                |
|---------------|----------|----------------|
| 应付托管费         |          | 29,206.09      |
| 应付销售服务费       |          | -              |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 303,997.49     |
| 应交税费          |          | -              |
| 应付利息          |          | -              |
| 应付利润          |          | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 1,112,358.76   |
| 负债合计          |          | 1,678,660.77   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 406,931,891.00 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -1,329,418.62  |
| 所有者权益合计       |          | 405,602,472.38 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 407,281,133.15 |

注：1. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9967 元，基金份额总额 406,931,891.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号      | 本期<br>2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）<br>至 2021 年 12 月 31 日 |
|-------------------|----------|------------------------------------------------------|
| 一、收入              |          | 45,717,525.23                                        |
| 1. 利息收入           |          | 325,979.10                                           |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.11 | 132,309.31                                           |
| 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        |          | 193,669.79                                           |
| 证券出借利息收入          |          | -                                                    |
| 其他利息收入            |          | -                                                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 62,978,525.33                                        |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.12 | 62,876,190.40                                        |
| 基金投资收益            |          | -                                                    |
| 债券投资收益            | 7.4.7.13 | -                                                    |
| 资产支持证券投资收益        |          | -                                                    |
| 贵金属投资收益           |          | -                                                    |
| 衍生工具收益            | 7.4.7.14 | -                                                    |

|                        |            |                |
|------------------------|------------|----------------|
| 股利收益                   | 7.4.7.15   | 102,334.93     |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16   | -18,908,049.92 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | 1,321,070.72   |
| 减：二、费用                 |            | 3,557,068.07   |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 1,075,665.39   |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 215,133.10     |
| 3. 销售服务费               |            | -              |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.18   | 2,076,988.37   |
| 5. 利息支出                |            | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -              |
| 6. 税金及附加               |            | -              |
| 7. 其他费用                | 7.4.7.19   | 189,281.21     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 42,160,457.16  |
| 减：所得税费用                |            | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 42,160,457.16  |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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）                        | 865,931,891.00                                   | -              | 865,931,891.00    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                | 42,160,457.16  | 42,160,457.16     |
| 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）      | -459,000,000.00                                  | -43,489,875.78 | -502,489,875.78   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 960,000,000.00                                   | 18,677,995.27  | 978,677,995.27    |
| 2. 基金赎回款                               | -1,419,000,000.00                                | -62,167,871.05 | -1,481,167,871.05 |
| 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）                        | 406,931,891.00                                   | -1,329,418.62  | 405,602,472.38    |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城国证新能源车电池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[2021]1752号《关于核准景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城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《景顺长城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》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,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865,874,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0693号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城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》于2021年7月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为865,931,891.00份基金份额,其中认购资金利息折合57,891.00份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]第767号文审核同意,本基金865,931,891.00份基金份额于2021年8月9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《景顺长城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》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数国证新能源车电池指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证,下同),投资于标的指数成份股及备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及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的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。本基金力争使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%。本基金的业绩比较基准为国证新能源车电池指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于2022年3月24日批准报出。

## 7.4.2 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》、本基金基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 7 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净值率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。



经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于

资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|
|----|-------------------------|

|                   |              |
|-------------------|--------------|
| 活期存款              | 4,747,534.77 |
| 定期存款              | -            |
| 其中：存款期限 1 个月以内    | -            |
| 存款期限 1 个月（含）-3 个月 | -            |
| 存款期限 3 个月（含）至 1 年 | -            |
| 存款期限 1 年（含）以上     | -            |
| 其他存款              | -            |
| 合计                | 4,747,534.77 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |                |                |
|---------------|-------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 420,004,575.88          | 401,096,525.96 | -18,908,049.92 |
| 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            | 420,004,575.88          | 401,096,525.96 | -18,908,049.92 |

注：于 2021 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 13.00 元。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|
| 应收活期存款利息   | 657.68                  |
| 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  | 141.02                  |
| 应收债券利息     | -                       |
| 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   | -        |
| 其他         | 352.20   |
| 合计         | 1,150.90 |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 303,997.49              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       |
| 合计          | 303,997.49              |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 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        | 180,936.00              |
| 应退替代款       | 931,240.86              |
| 可退替代款       | 181.90                  |
| 合计          | 1,112,358.76            |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|--------------------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                                          | 账面金额              |
| 基金合同生效日       | 865,931,891.00                                   | 865,931,891.00    |
| 本期申购          | 960,000,000.00                                   | 960,000,000.00    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,419,000,000.00                                | -1,419,000,000.00 |
| - 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           | 406,931,891.00                                   | 406,931,891.00    |

注：本基金合同于 2021 年 7 月 21 日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 865,874,000.00 元，折合 865,874,000.00 份基金份额；有效认购资金在首次发售

募集期内产生的利息为人民币 57,891.00 元, 折合 57,891.00 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 865,931,891.00 元, 折合 865,931,891.00 份基金份额。

#### 7.4.7.10 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        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日        | -              | -              | -              |
| 本期利润           | 61,068,507.08  | -18,908,049.92 | 42,160,457.16  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,633,767.43   | -46,123,643.21 | -43,489,875.78 |
| 其中: 基金申购款      | 68,886,523.31  | -50,208,528.04 | 18,677,995.27  |
| 基金赎回款          | -66,252,755.88 | 4,084,884.83   | -62,167,871.05 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 63,702,274.51  | -65,031,693.13 | -1,329,418.62  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 7 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 96,611.81                                          |
| 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 | 22,415.13                                          |
| 其他        | 13,282.37                                          |
| 合计        | 132,309.31                                         |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位: 人民币元

| 项目               | 本期<br>2021 年 7 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日 |
|------------------|----------------------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 21,139,631.84                                      |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 41,736,558.56                                      |
| 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               | 62,876,190.40                                      |

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位: 人民币元

| 项目          | 本期<br>2021 年 7 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额    | 398,791,506.20                                     |
| 减: 卖出股票成本总额 | 377,651,874.36                                     |
| 买卖股票差价收入    | 21,139,631.84                                      |

**7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2021年7月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 1,481,167,871.05                      |
| 减：现金支付赎回款总额 | 281,895,556.05                        |
| 减：赎回股票成本总额  | 1,157,535,756.44                      |
| 赎回差价收入      | 41,736,558.56                         |

**7.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期无债券投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年7月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 102,334.93                            |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | —                                     |
| 基金投资产生的股利收益   | —                                     |
| 合计            | 102,334.93                            |

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2021年7月21日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -18,908,049.92                        |
| 股票投资                   | -18,908,049.92                        |
| 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                     | -18,908,049.92                        |

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益13.00元。

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期                                         |
|---------|--------------------------------------------|
|         | 2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
| 基金赎回费收入 | -                                          |
| 替代损益    | 1,321,070.72                               |
| 合计      | 1,321,070.72                               |

注：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。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期                                         |
|-----------|--------------------------------------------|
|           | 2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
| 交易所市场交易费用 | 2,076,988.37                               |
| 银行间市场交易费用 | -                                          |
| 合计        | 2,076,988.37                               |

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期                                         |
|----------|--------------------------------------------|
|          | 2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
| 审计费用     | 54,000.00                                  |
| 信息披露费    | 60,000.00                                  |
| 证券出借违约金  | -                                          |
| IOPV 数据费 | 7,945.21                                   |
| 注册登记费    | 66,936.00                                  |
| 其他       | 400.00                                     |
| 合计       | 189,281.21                                 |

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 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。

**7.4.8.2 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。

**7.4.9 关联方关系**

| 关联方名称              | 与本基金的关系      |
|--------------------|--------------|
| 景顺长城基金管理有限公司       | 基金管理人、基金销售机构 |
| 华夏银行股份有限公司（“华夏银行”） | 基金托管人        |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人的股东     |

|                  |           |
|------------------|-----------|
| 景顺资产管理有限公司       | 基金管理人的股东  |
| 大连实德集团有限公司       | 基金管理人的股东  |
| 开滦(集团)有限责任公司     | 基金管理人的股东  |
| 景顺长城资产管理(深圳)有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,075,665.39                                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                                                |

注：支付基金管理人景顺长城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 × 0.50% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|--------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 215,133.10                                       |

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。

##### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。



**7.4.10.4 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****7.4.10.4.1 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**

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务交易。

**7.4.10.4.2 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**

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务交易。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.5.2 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**

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末未投资本基金。

**7.4.10.6 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<br>2021 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月<br>31 日 |           |
|---------|-----------------------------------------------------|-----------|
|         | 期末余额                                                | 当期利息收入    |
| 华夏银行-活期 | 4,747,534.77                                        | 96,611.81 |

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内无利润分配。

**7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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

**7.4.12.1.1 受限证券类别：股票**

| 证券代码   | 证券名称 | 成功认购日            | 可流通日            | 流通受限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量(单<br>位:股) | 期末成本总额   | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|------------------|-----------------|--------|----------|------------|--------------|----------|-----------|----|
| 001234 | 泰慕士  | 2021 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 11 日 | 新股流通受限 | 16.53    | 16.53      | 333          | 5,504.49 | 5,504.49  | -  |
| 300854 | 中兰环保 | 2021 年 9 月 8 日   | 2022 年 3 月 16 日 | 新股流通受限 | 9.96     | 27.29      | 203          | 2,021.88 | 5,539.87  | -  |
| 301057 | 汇隆新材 | 2021 年 8 月 31 日  | 2022 年 3 月 9 日  | 新股流通受限 | 8.03     | 19.02      | 218          | 1,750.54 | 4,146.36  | -  |
| 301058 | 中粮工科 | 2021 年 9 月 1 日   | 2022 年 3 月 9 日  | 新股流通受限 | 3.55     | 18.24      | 1,386        | 4,920.30 | 25,280.64 | -  |
| 301060 | 兰卫医学 | 2021 年 9 月 6 日   | 2022 年 3 月 14 日 | 新股流通受限 | 4.17     | 30.94      | 587          | 2,447.79 | 18,161.78 | -  |

|        |      |                  |                 |        |        |        |       |            |            |   |
|--------|------|------------------|-----------------|--------|--------|--------|-------|------------|------------|---|
| 301062 | 上海艾录 | 2021 年 9 月 7 日   | 2022 年 3 月 14 日 | 新股流通受限 | 3.31   | 17.01  | 523   | 1,731.13   | 8,896.23   | - |
| 301066 | 万事利  | 2021 年 9 月 13 日  | 2022 年 3 月 22 日 | 新股流通受限 | 5.24   | 22.84  | 344   | 1,802.56   | 7,856.96   | - |
| 301068 | 大地海洋 | 2021 年 9 月 16 日  | 2022 年 3 月 28 日 | 新股流通受限 | 13.98  | 28.38  | 144   | 2,013.12   | 4,086.72   | - |
| 301073 | 君亭酒店 | 2021 年 9 月 22 日  | 2022 年 3 月 30 日 | 新股流通受限 | 12.24  | 32.00  | 144   | 1,762.56   | 4,608.00   | - |
| 301079 | 邵阳液压 | 2021 年 10 月 11 日 | 2022 年 4 月 19 日 | 新股流通受限 | 11.92  | 24.82  | 140   | 1,668.80   | 3,474.80   | - |
| 301081 | 严牌股份 | 2021 年 10 月 13 日 | 2022 年 4 月 20 日 | 新股流通受限 | 12.95  | 17.44  | 403   | 5,218.85   | 7,028.32   | - |
| 301082 | 久盛电气 | 2021 年 10 月 14 日 | 2022 年 4 月 27 日 | 新股流通受限 | 15.48  | 21.53  | 915   | 14,164.20  | 19,699.95  | - |
| 301083 | 百胜智能 | 2021 年 10 月 13 日 | 2022 年 4 月 21 日 | 新股流通受限 | 9.08   | 14.21  | 416   | 3,777.28   | 5,911.36   | - |
| 301087 | 可孚医疗 | 2021 年 10 月 15 日 | 2022 年 4 月 25 日 | 新股流通受限 | 93.09  | 75.34  | 281   | 26,158.29  | 21,170.54  | - |
| 301088 | 戎美股份 | 2021 年 10 月 19 日 | 2022 年 4 月 28 日 | 新股流通受限 | 33.16  | 24.67  | 552   | 18,304.32  | 13,617.84  | - |
| 301092 | 争光股份 | 2021 年 10 月 21 日 | 2022 年 5 月 5 日  | 新股流通受限 | 36.31  | 35.52  | 323   | 11,728.13  | 11,472.96  | - |
| 301093 | 华兰股份 | 2021 年 10 月 21 日 | 2022 年 5 月 5 日  | 新股流通受限 | 58.08  | 49.85  | 327   | 18,992.16  | 16,300.95  | - |
| 301096 | 百诚医药 | 2021 年 12 月 13 日 | 2022 年 6 月 20 日 | 新股流通受限 | 79.60  | 78.53  | 106   | 8,437.60   | 8,324.18   | - |
| 301098 | 金埔园林 | 2021 年 11 月 4 日  | 2022 年 5 月 12 日 | 新股流通受限 | 12.36  | 22.17  | 307   | 3,794.52   | 6,806.19   | - |
| 301099 | 雅创电子 | 2021 年 11 月 10 日 | 2022 年 5 月 23 日 | 新股流通受限 | 21.99  | 71.36  | 351   | 7,718.49   | 25,047.36  | - |
| 301100 | 风光股份 | 2021 年 12 月 10 日 | 2022 年 6 月 17 日 | 新股流通受限 | 27.81  | 31.14  | 360   | 10,011.60  | 11,210.40  | - |
| 301101 | 明月镜片 | 2021 年 12 月 9 日  | 2022 年 6 月 16 日 | 新股流通受限 | 26.91  | 43.36  | 371   | 9,983.61   | 16,086.56  | - |
| 301108 | 洁雅股份 | 2021 年 11 月 25 日 | 2022 年 6 月 6 日  | 新股流通受限 | 57.27  | 53.71  | 140   | 8,017.80   | 7,519.40   | - |
| 301111 | 粤万年青 | 2021 年 11 月 30 日 | 2022 年 6 月 7 日  | 新股流通受限 | 10.48  | 36.68  | 379   | 3,971.92   | 13,901.72  | - |
| 301118 | 恒光股份 | 2021 年 11 月 9 日  | 2022 年 5 月 18 日 | 新股流通受限 | 22.70  | 49.02  | 315   | 7,150.50   | 15,441.30  | - |
| 301126 | 达嘉维康 | 2021 年 11 月 30 日 | 2022 年 6 月 7 日  | 新股流通受限 | 12.37  | 19.23  | 662   | 8,188.94   | 12,730.26  | - |
| 301127 | 天源环保 | 2021 年 12 月 23 日 | 2022 年 6 月 30 日 | 新股流通受限 | 12.03  | 17.12  | 1,194 | 14,363.82  | 20,441.28  | - |
| 301133 | 金钟股份 | 2021 年 11 月 19 日 | 2022 年 5 月 26 日 | 新股流通受限 | 14.33  | 26.95  | 286   | 4,098.38   | 7,707.70   | - |
| 301138 | 华研精机 | 2021 年 12 月 8 日  | 2022 年 6 月 15 日 | 新股流通受限 | 26.17  | 44.86  | 285   | 7,458.45   | 12,785.10  | - |
| 301149 | 隆华新材 | 2021 年 11 月 3 日  | 2022 年 5 月 10 日 | 新股流通受限 | 10.07  | 16.76  | 1,214 | 12,224.98  | 20,346.64  | - |
| 301155 | 海力风电 | 2021 年 11 月 17 日 | 2022 年 5 月 24 日 | 新股流通受限 | 60.66  | 96.75  | 246   | 14,922.36  | 23,800.50  | - |
| 301166 | 优宁维  | 2021 年 12 月 21 日 | 2022 年 6 月 28 日 | 新股流通受限 | 86.06  | 94.50  | 127   | 10,929.62  | 12,001.50  | - |
| 301168 | 通灵股份 | 2021 年 12 月 2 日  | 2022 年 6 月 10 日 | 新股流通受限 | 39.08  | 52.13  | 253   | 9,887.24   | 13,188.89  | - |
| 301177 | 迪阿股份 | 2021 年 12 月 8 日  | 2022 年 6 月 15 日 | 新股流通受限 | 116.88 | 116.08 | 152   | 17,765.76  | 17,644.16  | - |
| 301179 | 泽宇智能 | 2021 年 12 月 1 日  | 2022 年 6 月 8 日  | 新股流通受限 | 43.99  | 50.77  | 173   | 7,610.27   | 8,783.21   | - |
| 301182 | 凯旺科技 | 2021 年 12 月 16 日 | 2022 年 6 月 23 日 | 新股流通受限 | 27.12  | 30.58  | 294   | 7,973.28   | 8,990.52   | - |
| 301185 | 鸥玛软件 | 2021 年 11 月 11 日 | 2022 年 5 月 19 日 | 新股流通受限 | 11.88  | 21.16  | 578   | 6,866.64   | 12,230.48  | - |
| 301188 | 力诺特玻 | 2021 年 11 月 4 日  | 2022 年 5 月 11 日 | 新股流通受限 | 13.00  | 20.48  | 647   | 8,411.00   | 13,250.56  | - |
| 301189 | 奥尼电子 | 2021 年 12 月 21 日 | 2022 年 6 月 28 日 | 新股流通受限 | 66.18  | 56.62  | 198   | 13,103.64  | 11,210.76  | - |
| 301190 | 善水科技 | 2021 年 12 月 17 日 | 2022 年 6 月 24 日 | 新股流通受限 | 27.85  | 27.46  | 335   | 9,329.75   | 9,199.10   | - |
| 301193 | 家联科技 | 2021 年 12 月 2 日  | 2022 年 6 月 9 日  | 新股流通受限 | 30.73  | 29.14  | 297   | 9,126.81   | 8,654.58   | - |
| 301198 | 喜悦智行 | 2021 年 11 月 25 日 | 2022 年 6 月 2 日  | 新股流通受限 | 21.76  | 29.20  | 262   | 5,701.12   | 7,650.40   | - |
| 301199 | 迈赫股份 | 2021 年 11 月 30 日 | 2022 年 6 月 7 日  | 新股流通受限 | 29.28  | 32.00  | 343   | 10,043.04  | 10,976.00  | - |
| 301211 | 亨迪药业 | 2021 年 12 月 14 日 | 2022 年 6 月 22 日 | 新股流通受限 | 25.80  | 33.65  | 522   | 13,467.60  | 17,565.30  | - |
| 301221 | 光庭信息 | 2021 年 12 月 15 日 | 2022 年 6 月 22 日 | 新股流通受限 | 69.89  | 88.72  | 152   | 10,623.28  | 13,485.44  | - |
| 688105 | 诺唯赞  | 2021 年 11 月 5 日  | 2022 年 5 月 16 日 | 新股流通受限 | 55.00  | 93.29  | 2,181 | 119,955.00 | 203,465.49 | - |
| 688257 | 新锐股份 | 2021 年 10 月 19 日 | 2022 年 4 月 27 日 | 新股流通受限 | 62.30  | 61.10  | 2,899 | 180,607.70 | 177,128.90 | - |

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终可流通日期以上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的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。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

#### 7.4.13.2 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同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进

行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券。

### 7.4.13.3 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投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

#### 7.4.13.3.1 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日

可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 1 个月以内       | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
|-------------------------|--------------|--------|----------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产                      |              |        |          |       |       |                |                |
| 银行存款                    | 4,747,534.77 | -      | -        | -     | -     | -              | 4,747,534.77   |
| 结算备付金                   | 288,502.82   | -      | -        | -     | -     | -              | 288,502.82     |
| 存出保证金                   | 782,630.54   | -      | -        | -     | -     | -              | 782,630.54     |
| 交易性金融资产                 | -            | -      | -        | -     | -     | 401,096,525.96 | 401,096,525.96 |
| 应收利息                    | -            | -      | -        | -     | -     | 1,150.90       | 1,150.90       |
| 应收证券清算款                 | -            | -      | -        | -     | -     | 364,788.16     | 364,788.16     |
| 资产总计                    | 5,818,668.13 | -      | -        | -     | -     | 401,462,465.02 | 407,281,133.15 |
| 负债                      |              |        |          |       |       |                |                |
| 应付管理人报酬                 | -            | -      | -        | -     | -     | 146,030.41     | 146,030.41     |
| 应付托管费                   | -            | -      | -        | -     | -     | 29,206.09      | 29,206.09      |

|         |              |   |   |   |   |              |              |
|---------|--------------|---|---|---|---|--------------|--------------|
| 应付证券清算款 | -            | - | - | - | - | 87,068.02    | 87,068.02    |
| 应付交易费用  | -            | - | - | - | - | 303,997.49   | 303,997.49   |
| 其他负债    | -            | - | - | - | - | 1,112,358.76 | 1,112,358.76 |
| 负债总计    | -            | - | - | - | - | 1,678,660.77 | 1,678,660.77 |
| 利率敏感度缺口 | 5,818,668.13 | - | - | - | - | -            | -            |

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |              |
|---------------|-------------------------|--------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 401,096,525.96          | 98.89        |
| 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            | 401,096,525.96          | 98.89        |

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数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（2021 年 12 月 31 日）       |
| 分析 | 沪深 300 指数上升 5%          | 20,835,032.51               |
|    | 沪深 300 指数下降 5%          | -20,835,032.51              |

**7.4.14 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 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 400,166,194.31 元，属于第二层次的余额为 930,331.65 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

**(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 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 978,677,995.27 元，其中包括以股票支付的申购款 694,149,860.30 元和以现金支付的申购款 284,528,134.97 元。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021 年的比较数据将不作重述。

(4)除公允价值、基金申购款和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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              | 401,096,525.96 | 98.48        |
|    | 其中:股票             | 401,096,525.96 | 98.48        |
| 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      | 5,036,037.59   | 1.24         |
| 8  | 其他各项资产            | 1,148,569.60   | 0.28         |
| 9  | 合计                | 407,281,133.15 | 100.00       |

注:权益投资股票项中,含可退替代款估值增值 13.00 元,表 8.2 中不含此项,因此二者存在差异。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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              | 5,999,915.00   | 1.48  |
| C | 制造业              | 387,183,825.00 | 95.46 |
| 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               | 6,977,727.51   | 1.72  |
|   | 合计               | 400,161,467.51 | 98.66 |

### 8.2.2 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              | 522,163.97 | 0.13         |
| 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           | 81,041.12  | 0.02         |
| 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  | 34,499.13  | 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       | 237,070.31 | 0.06         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 25,981.15  | 0.01         |
| 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               | -          | -            |
|    | 合计               | 935,045.45 | 0.23         |

**8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

无。

**8.3 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****8.3.1 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  | 300750 | 宁德时代 | 101,592   | 59,736,096.00 | 14.73        |
| 2  | 002594 | 比亚迪  | 192,573   | 51,632,672.76 | 12.73        |
| 3  | 300014 | 亿纬锂能 | 283,487   | 33,502,493.66 | 8.26         |
| 4  | 002812 | 恩捷股份 | 111,100   | 27,819,440.00 | 6.86         |
| 5  | 002460 | 赣锋锂业 | 181,897   | 25,983,986.45 | 6.41         |
| 6  | 603799 | 华友钴业 | 220,165   | 24,286,401.15 | 5.99         |
| 7  | 300450 | 先导智能 | 226,100   | 16,815,057.00 | 4.15         |
| 8  | 002709 | 天赐材料 | 130,231   | 14,930,984.15 | 3.68         |
| 9  | 002074 | 国轩高科 | 246,656   | 12,641,120.00 | 3.12         |
| 10 | 603659 | 璞泰来  | 71,300    | 11,451,493.00 | 2.82         |
| 11 | 002340 | 格林美  | 1,021,564 | 10,573,187.40 | 2.61         |
| 12 | 002050 | 三花智控 | 409,850   | 10,369,205.00 | 2.56         |
| 13 | 300207 | 欣旺达  | 242,992   | 10,244,542.72 | 2.53         |
| 14 | 600884 | 杉杉股份 | 238,393   | 7,812,138.61  | 1.93         |
| 15 | 000009 | 中国宝安 | 483,557   | 6,977,727.51  | 1.72         |
| 16 | 300073 | 当升科技 | 80,000    | 6,949,600.00  | 1.71         |
| 17 | 300037 | 新宙邦  | 59,800    | 6,757,400.00  | 1.67         |
| 18 | 603026 | 石大胜华 | 33,000    | 6,533,670.00  | 1.61         |
| 19 | 300769 | 德方纳米 | 12,900    | 6,335,964.00  | 1.56         |
| 20 | 002407 | 多氟多  | 133,669   | 6,013,768.31  | 1.48         |
| 21 | 002192 | 融捷股份 | 46,100    | 5,999,915.00  | 1.48         |
| 22 | 300568 | 星源材质 | 147,508   | 5,417,968.84  | 1.34         |
| 23 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 193,300   | 5,317,683.00  | 1.31         |
| 24 | 002850 | 科达利  | 29,100    | 4,665,894.00  | 1.15         |
| 25 | 600110 | 诺德股份 | 289,101   | 4,611,160.95  | 1.14         |
| 26 | 300618 | 寒锐钴业 | 49,800    | 3,992,964.00  | 0.98         |
| 27 | 600549 | 厦门钨业 | 176,200   | 3,987,406.00  | 0.98         |
| 28 | 300001 | 特锐德  | 142,100   | 3,534,027.00  | 0.87         |
| 29 | 002056 | 横店东磁 | 183,600   | 3,464,532.00  | 0.85         |
| 30 | 300919 | 中伟股份 | 11,900    | 1,802,969.00  | 0.44         |

**8.3.2 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  | 688105 | 诺唯赞  | 2,181 | 203,465.49 | 0.05         |
| 2  | 688257 | 新锐股份 | 2,899 | 177,128.90 | 0.04         |
| 3  | 301058 | 中粮工科 | 1,386 | 25,280.64  | 0.01         |
| 4  | 301099 | 雅创电子 | 351   | 25,047.36  | 0.01         |
| 5  | 301155 | 海力风电 | 246   | 23,800.50  | 0.01         |
| 6  | 301087 | 可孚医疗 | 281   | 21,170.54  | 0.01         |
| 7  | 301127 | 天源环保 | 1,194 | 20,441.28  | 0.01         |
| 8  | 301149 | 隆华新材 | 1,214 | 20,346.64  | 0.01         |
| 9  | 301082 | 久盛电气 | 915   | 19,699.95  | 0.00         |
| 10 | 301060 | 兰卫医学 | 587   | 18,161.78  | 0.00         |
| 11 | 301177 | 迪阿股份 | 152   | 17,644.16  | 0.00         |
| 12 | 301211 | 亨迪药业 | 522   | 17,565.30  | 0.00         |
| 13 | 301093 | 华兰股份 | 327   | 16,300.95  | 0.00         |
| 14 | 301101 | 明月镜片 | 371   | 16,086.56  | 0.00         |
| 15 | 301118 | 恒光股份 | 315   | 15,441.30  | 0.00         |
| 16 | 301111 | 粤万年青 | 379   | 13,901.72  | 0.00         |
| 17 | 301088 | 戎美股份 | 552   | 13,617.84  | 0.00         |
| 18 | 301221 | 光庭信息 | 152   | 13,485.44  | 0.00         |
| 19 | 301188 | 力诺特玻 | 647   | 13,250.56  | 0.00         |
| 20 | 301168 | 通灵股份 | 253   | 13,188.89  | 0.00         |
| 21 | 301138 | 华研精机 | 285   | 12,785.10  | 0.00         |
| 22 | 301126 | 达嘉维康 | 662   | 12,730.26  | 0.00         |
| 23 | 301185 | 鸥玛软件 | 578   | 12,230.48  | 0.00         |
| 24 | 301166 | 优宁维  | 127   | 12,001.50  | 0.00         |
| 25 | 301092 | 争光股份 | 323   | 11,472.96  | 0.00         |
| 26 | 301189 | 奥尼电子 | 198   | 11,210.76  | 0.00         |
| 27 | 301100 | 风光股份 | 360   | 11,210.40  | 0.00         |
| 28 | 301199 | 迈赫股份 | 343   | 10,976.00  | 0.00         |
| 29 | 301190 | 善水科技 | 335   | 9,199.10   | 0.00         |
| 30 | 301182 | 凯旺科技 | 294   | 8,990.52   | 0.00         |
| 31 | 301062 | 上海艾录 | 523   | 8,896.23   | 0.00         |
| 32 | 301179 | 泽宇智能 | 173   | 8,783.21   | 0.00         |
| 33 | 301193 | 家联科技 | 297   | 8,654.58   | 0.00         |
| 34 | 301096 | 百诚医药 | 106   | 8,324.18   | 0.00         |
| 35 | 301066 | 万事利  | 344   | 7,856.96   | 0.00         |
| 36 | 301133 | 金钟股份 | 286   | 7,707.70   | 0.00         |
| 37 | 301198 | 喜悦智行 | 262   | 7,650.40   | 0.00         |
| 38 | 301108 | 洁雅股份 | 140   | 7,519.40   | 0.00         |
| 39 | 301081 | 严牌股份 | 403   | 7,028.32   | 0.00         |
| 40 | 301098 | 金埔园林 | 307   | 6,806.19   | 0.00         |
| 41 | 301083 | 百胜智能 | 416   | 5,911.36   | 0.00         |
| 42 | 300854 | 中兰环保 | 203   | 5,539.87   | 0.00         |

|    |        |      |       |          |      |
|----|--------|------|-------|----------|------|
| 43 | 001234 | 泰慕士  | 333   | 5,504.49 | 0.00 |
| 44 | 603176 | 汇通集团 | 1,924 | 4,713.80 | 0.00 |
| 45 | 301073 | 君亭酒店 | 144   | 4,608.00 | 0.00 |
| 46 | 301057 | 汇隆新材 | 218   | 4,146.36 | 0.00 |
| 47 | 301068 | 大地海洋 | 144   | 4,086.72 | 0.00 |
| 48 | 301079 | 邵阳液压 | 140   | 3,474.80 | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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       | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 124,912,759.96 | 30.80          |
| 2  | 603799 | 华友钴业 | 117,554,998.99 | 28.98          |
| 3  | 002594 | 比亚迪  | 117,426,580.62 | 28.95          |
| 4  | 002812 | 恩捷股份 | 82,600,492.60  | 20.36          |
| 5  | 002460 | 赣锋锂业 | 76,813,774.58  | 18.94          |
| 6  | 300014 | 亿纬锂能 | 75,449,642.30  | 18.60          |
| 7  | 603659 | 璞泰来  | 56,471,609.33  | 13.92          |
| 8  | 603026 | 石大胜华 | 43,675,466.47  | 10.77          |
| 9  | 300450 | 先导智能 | 41,522,271.47  | 10.24          |
| 10 | 002709 | 天赐材料 | 38,479,293.52  | 9.49           |
| 11 | 600884 | 杉杉股份 | 34,321,459.93  | 8.46           |
| 12 | 002074 | 国轩高科 | 31,583,089.12  | 7.79           |
| 13 | 002340 | 格林美  | 29,180,645.00  | 7.19           |
| 14 | 000009 | 中国宝安 | 23,526,301.17  | 5.80           |
| 15 | 600110 | 诺德股份 | 23,463,668.00  | 5.78           |
| 16 | 600549 | 厦门钨业 | 22,568,778.01  | 5.56           |
| 17 | 002050 | 三花智控 | 21,956,520.00  | 5.41           |
| 18 | 300207 | 欣旺达  | 21,564,550.52  | 5.32           |
| 19 | 600699 | 均胜电子 | 19,581,422.98  | 4.83           |
| 20 | 300037 | 新宙邦  | 18,656,189.00  | 4.60           |
| 21 | 600482 | 中国动力 | 17,669,996.51  | 4.36           |
| 22 | 002192 | 融捷股份 | 17,214,796.00  | 4.24           |
| 23 | 300568 | 星源材质 | 17,092,396.63  | 4.21           |
| 24 | 002407 | 多氟多  | 16,382,125.16  | 4.04           |
| 25 | 300073 | 当升科技 | 14,335,670.92  | 3.53           |
| 26 | 300769 | 德方纳米 | 13,465,296.00  | 3.32           |
| 27 | 002850 | 科达利  | 11,922,574.00  | 2.94           |
| 28 | 600580 | 卧龙电驱 | 11,552,335.06  | 2.85           |
| 29 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 11,398,583.00  | 2.81           |
| 30 | 300618 | 寒锐钴业 | 10,424,561.18  | 2.57           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 31 | 300001 | 特锐德  | 9,633,539.00 | 2.38 |
| 32 | 601311 | 骆驼股份 | 9,128,995.30 | 2.25 |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 603799 | 华友钴业 | 89,990,307.29 | 22.19          |
| 2  | 603659 | 璞泰来  | 48,109,190.70 | 11.86          |
| 3  | 603026 | 石大胜华 | 38,702,910.24 | 9.54           |
| 4  | 600884 | 杉杉股份 | 29,387,308.00 | 7.25           |
| 5  | 600110 | 诺德股份 | 20,555,230.01 | 5.07           |
| 6  | 600699 | 均胜电子 | 19,044,099.60 | 4.70           |
| 7  | 600482 | 中国动力 | 18,380,326.78 | 4.53           |
| 8  | 600549 | 厦门钨业 | 17,442,965.98 | 4.30           |
| 9  | 600580 | 卧龙电驱 | 12,658,266.00 | 3.12           |
| 10 | 002460 | 赣锋锂业 | 10,534,348.00 | 2.60           |
| 11 | 300769 | 德方纳米 | 10,377,673.00 | 2.56           |
| 12 | 601311 | 骆驼股份 | 9,704,334.70  | 2.39           |
| 13 | 300037 | 新宙邦  | 6,225,629.00  | 1.53           |
| 14 | 300014 | 亿纬锂能 | 4,732,909.00  | 1.17           |
| 15 | 002594 | 比亚迪  | 3,555,568.00  | 0.88           |
| 16 | 300450 | 先导智能 | 3,403,195.00  | 0.84           |
| 17 | 002709 | 天赐材料 | 3,152,047.00  | 0.78           |
| 18 | 300432 | 富临精工 | 3,122,057.00  | 0.77           |
| 19 | 300035 | 中科电气 | 2,920,765.00  | 0.72           |
| 20 | 300438 | 鹏辉能源 | 2,825,884.00  | 0.70           |

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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 | 1,261,042,346.38 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 398,791,506.20   |

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 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**

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**8.12.2 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未超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 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   | 782,630.54 |
| 2  | 应收证券清算款 | 364,788.16 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利  | —            |
| 4 | 应收利息  | 1,150.90     |
| 5 | 应收申购款 | —            |
| 6 | 其他应收款 | —            |
| 7 | 待摊费用  | —            |
| 8 | 其他    | —            |
| 9 | 合计    | 1,148,569.60 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 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  | 688105 | 诺唯赞  | 203,465.49  | 0.05          | 新股流通受限   |
| 2  | 688257 | 新锐股份 | 177,128.90  | 0.04          | 新股流通受限   |
| 3  | 301058 | 中粮工科 | 25,280.64   | 0.01          | 新股流通受限   |
| 4  | 301099 | 雅创电子 | 25,047.36   | 0.01          | 新股流通受限   |
| 5  | 301155 | 海力风电 | 23,800.50   | 0.01          | 新股流通受限   |

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 (%) |
| 10,751       | 37,850.61     | 69,602,135.00 | 17.10      | 337,329,756.00 | 82.90      |

### 9.2 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  | 中信证券股份有限公司   | 17,737,987.00 | 4.36 |
| 2  | 招商证券股份有限公司   | 16,526,710.00 | 4.06 |
| 3  | 中信建投证券股份有限公司 | 16,150,181.00 | 3.97 |
| 4  | 方正证券股份有限公司   | 13,409,207.00 | 3.30 |
| 5  | 张庆先          | 5,000,000.00  | 1.23 |
| 6  | 郭建平          | 3,979,300.00  | 0.98 |
| 7  | 王雪有          | 3,500,000.00  | 0.86 |
| 8  | 栗新宏          | 3,099,900.00  | 0.76 |
| 9  | 刘满国          | 2,105,000.00  | 0.52 |
| 10 | 何海波          | 1,986,000.00  | 0.49 |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

### 9.4 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

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021年7月21日）基金份额总额          | 865,931,891.00   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 960,000,000.00   |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 1,419,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 406,931,891.00   |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

- 1、本管理人于2021年3月30日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任刘彦春先生担任本公司副总经理。



上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

1、本报告期内，本基金的托管人 2021 年 5 月 11 日发布公告，胡捷先生自 2021 年 4 月 30 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金的托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

2、本报告期内，本基金的托管人 2021 年 8 月 13 日发布公告，国然女士自 2021 年 8 月 9 日起担任华夏银行股份有限公司资产托管部副总经理。本基金的托管人已将上述变更事项报相关监管部门备案。

### 11.3 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财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 1 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 54,000.00。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 |    |
| 招商证券股份有限公司 | 4      | 1,652,909,857.82 | 100.00%      | 1,517,399.27 | 100.00%    | -  |

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

## 1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

## 2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

## 2、本基金与景顺长城景泰益利基金共用交易单元。

## 11.7.2 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 |
| 招商证券股份有限公司 | -    | -            | 1,200,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## 11.8 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  | 景顺长城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     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-28 |
| 2  | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-28 |
| 3  | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-28 |
| 4  | 景顺长城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     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-28 |
| 5  | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金招募说明书    | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-28 |

|    |                                                        |              |            |
|----|--------------------------------------------------------|--------------|------------|
| 6  | 景顺长城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及招募说明书提示性公告              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-06-28 |
| 7  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-07-09 |
| 8  | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-07-13 |
| 9  | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-07-16 |
| 10 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-07-20 |
| 11 | 关于景顺长城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生效公告                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-07-22 |
| 12 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-07-23 |
| 13 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-07-27 |
| 14 | 关于景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金关于开放日常申购和赎回业务的公告           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-04 |
| 15 | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告                 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-04 |
| 16 | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-04 |
| 17 | 关于景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金新增国泰君安证券等多家一级交易商的公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-05 |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-06 |
| 19 | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告                    | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-09 |
| 20 | 关于景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-09 |
| 21 | 关于景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金新增中信建投证券和申万宏源西部证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-10 |

|    |                                               |              |            |
|----|-----------------------------------------------|--------------|------------|
| 22 | 关于景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-13 |
| 23 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-20 |
| 24 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-21 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-27 |
| 26 | 关于旗下部分基金新增国信证券为一级交易商的公告                       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-08-30 |
| 27 | 景顺长城基金将积极参与投资北京证券交易所上市企业                      | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-09-07 |
| 28 | 景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-10-15 |
| 29 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-10-15 |
| 30 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-10-22 |
| 31 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-10-27 |
| 32 | 景顺长城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 3 季度报告     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-10-27 |
| 33 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票的风险提示性公告   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-11-16 |
| 34 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-11-18 |
| 35 | 景顺长城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 1 号更新招募说明书 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-11-30 |
| 36 | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-11-30 |
| 37 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-03 |
| 38 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-10 |
| 39 | 关于景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告         | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-11 |
| 40 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-16 |

|    |                                             |              |            |
|----|---------------------------------------------|--------------|------------|
|    | 司开展赎回费率优惠活动的公告                              |              |            |
| 41 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-17 |
| 42 | 景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-17 |
| 43 | 关于景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金新增华泰证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-21 |
| 44 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告                     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-24 |
| 45 | 景顺长城基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2021-12-29 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

经深圳证券交易所核准，本基金自 2021 年 8 月 9 日开始在深圳证券交易所上市交易。本基金场内简称：电池 50（2021 年 8 月 23 日起变更为“电池 ETF 基金”，2021 年 12 月 13 日起变更为“电池 30ETF”），基金代码：159757。详情请参阅本基金管理人于 2021 年 8 月 4 日发布的《景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城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》；
- 3、《景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城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》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### **13.2 存放地点**

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### **13.3 查阅方式**

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2022 年 3 月 28 日