

景顺长城新能源产业股票型证券投资基金

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	景顺长城新能源产业股票
基金主代码	011328
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 22 日
报告期末基金份额总额	5,951,421,626.56 份
投资目标	本基金通过自下而上的专业化研究分析，臻选优质新能源产业主题相关的上市公司。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括： 1、资产配置策略 本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。 2、股票投资策略 本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选符合新能源产业主题的股票构建投资组合。 3、存托凭证投资策略 本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述境内上市交易的股票投资策略，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。

	4、债券投资策略 债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。 5、股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。 6、融资交易策略 本基金可通过融资交易的杠杆作用，在符合融资交易各项法规要求及风险控制要求的前提下，放大投资收益。 7、股票期权投资策略 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。 8、国债期货投资策略 本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。 9、资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。	
业绩比较基准	中证新能源指数收益率*75%+恒生能源行业指数收益率*10%+中证全债指数收益率*15%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。 本基金还可投资港股通标的的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	景顺长城新能源产业股票 A 类	景顺长城新能源产业股票 C 类
下属分级基金的交易代码	011328	011329
报告期末下属分级基金的份额总额	2,137,302,237.46 份	3,814,119,389.10 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）	
	景顺长城新能源产业股票 A 类	景顺长城新能源产业股票 C 类
1. 本期已实现收益	-46,668,419.70	-83,398,195.32
2. 本期利润	59,083,675.46	103,979,772.08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0274	0.0274
4. 期末基金资产净值	2,493,295,574.78	4,439,986,050.26
5. 期末基金份额净值	1.1665	1.1640

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

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

3.2 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

景顺长城新能源产业股票 A 类

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.47%	1.18%	-0.97%	1.01%	3.44%	0.17%
过去六个月	-5.05%	1.44%	-6.08%	1.29%	1.03%	0.15%
过去一年	-11.83%	1.89%	-9.99%	1.58%	-1.84%	0.31%
自基金合同生效起至今	16.65%	1.88%	2.74%	1.71%	13.91%	0.17%

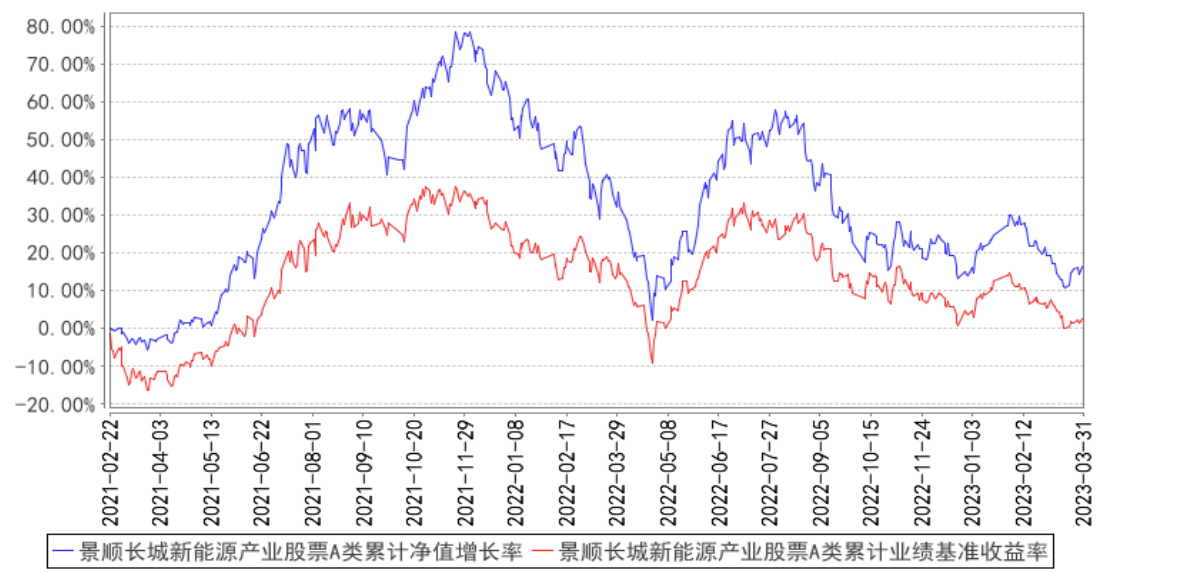
景顺长城新能源产业股票 C 类

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.44%	1.18%	-0.97%	1.01%	3.41%	0.17%
过去六个月	-5.10%	1.44%	-6.08%	1.29%	0.98%	0.15%
过去一年	-11.92%	1.89%	-9.99%	1.58%	-1.93%	0.31%
自基金合同生效起至今	16.40%	1.88%	2.74%	1.71%	13.66%	0.17%

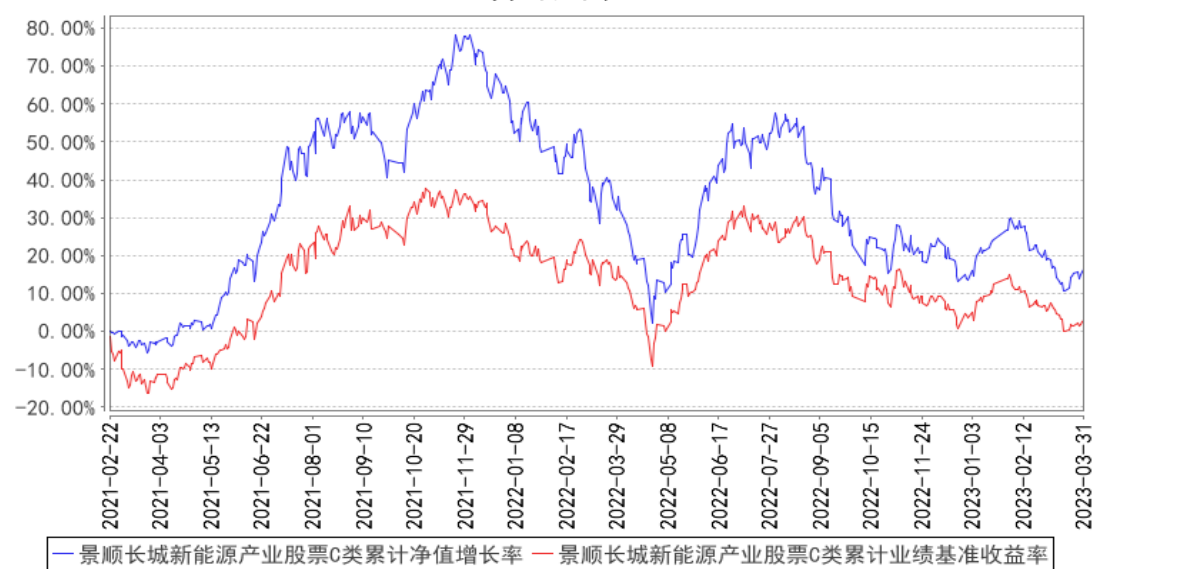
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率率变动的比较

景顺长城新能源产业股票A类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



景顺长城新能源产业股票C类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：投资组合比例：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），投资于新能源产业主题股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、

股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2021 年 2 月 22 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨锐文	本基金的基金经理	2021 年 2 月 22 日	—	13 年	工学硕士、理学硕士。曾任上海常春藤衍生投资公司分析部高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2014 年 10 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部执行总监、基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。
曾英捷	本基金的基金经理助理	2023 年 3 月 1 日	—	5 年	工学硕士。曾任一汽大众规划部工程师，宝能钜盛华财务部经营分析师，兴业证券股份有限公司经济与金融研究院分析师。2020 年 12 月加入本公司，担任研究部研究员，现任基金经理助理。具有 5 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。

4.1.1 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。

4.2 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、《景顺长城新能源产业股票型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規及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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基金和投资组合。

4.3.2 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 13 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本季度，国内疫情消退，经济开始走向复苏。尽管短期内的复苏力度还是相对弱，但是，一切已经走向正循环，随着时间的推移，企业信心和消费者信心将会不断增强，复苏力度会越来越强。本季度，TMT 以及国企改革相关股票表现较强，地产、新能源及消费相关的股票表现较弱。沪深 300 上涨 4.63%，而创业板指和科创 50 表现差别较大，分别上涨 2.25% 和 12.67%。

本季度，由于市场担心 2022 年底电动车补贴取消前的冲量行为对 2023 年的需求透支以及 2023 年一季度燃油车持续价格战，本基金重仓的新能源汽车产业链相关公司表现萎靡，对本基金的表现带来一定的拖累。但是，展望后市，我们对我们的投资方向和组合依旧充满信心，因为无论市场变化，我们始终坚持投资具有伟大前景的新兴产业企业，并伴随他们的成长，而不是趋势增强、寻求市场热点。我们相信未来的胜者一定是不断高强度投入的企业。尽管这些企业不一定是当前的焦点，但是，我们相信厚积薄发才能换取长期的发展。尽管这个过程充满艰难与痛苦，我们仍会坚持我们的选择和风格，也会不断优化和改进我们的持仓组合。

众所周知，疫情已经走向结束，所有的包袱都留在 2022 年，2023 年迎来全新的开始。过去三年的疫情对各类主体的资产负债表受损严重，出现明显的疤痕效应，尽管疫情已经过去了，但是，经济不可能像一些人预期那样出现报复性反弹。我们政府鼓励通过劳动获取收入，而不是通过“发钱”的形式来刺激消费，这决定我们的消费复苏会较为缓慢且更具有持续性。今年以来，政府也不断强调加强和支持民营经济，随着市场信心的修复，活力自然会好起来，一切将走向正

循环。但是，过高的居民资产负债率束缚了居民加杠杆的能力，以及人口拐点已现，房地产不可能回到从前，这会明显约束地方政府的投资能力，老的道路已经走不通，这决定了未来的经济增长将会更加倚重以数字经济和新基建为代表的新的增长引擎。

在上个季度报告中，我们表达了非常鲜明看好市场的观点，我们本季度继续旗帜鲜明看好市场，深信机会已经到来，我们在去年寒冬时期埋下希望与坚持的种子，深信会在 2023 年生根发芽，迎来阳光灿烂，争取给投资者带来良好的回报。

从全球经济的角度，周边的形势给我们带来越来越大的挑战。美联储史无前例的快速加息过程中，欧美银行不断暴雷，政府发钱刺激消费的边际效益越来越弱，需求颓势越来越明显，其中，欧洲问题尤其严重。欧洲的工业过去很大程度依赖于俄罗斯的廉价能源，俄乌战争以及北溪管道被炸让欧洲的能源问题几乎成为不可控的问题。欧洲的低能源成本优势或许已经一去不复返了，这对欧洲的工业体系或许带来毁灭性的打击。欧洲的困境同时也让全球经济陷入增长泥潭中，但是相对来看，中美会是相对受益的。世界格局在急剧变化，时势越发混沌，中美这样的大国在经济、政治的稳定性上的优势将会表现得淋漓尽致。因此，我们的发展更取决于我们自身在这场百年不遇之变局中的表现，过去三十年打造了号称“世界工厂”的制造业将是确保我们继续平稳前行的砝码。

美联储的货币政策预计会持续收紧，直到经济带来的痛苦大于通胀带来的痛苦，这基本决定了美国的经济硬着陆也是不可避免的。美国加息带来的资金回流将会全面推升其他国家的资金成本，欧洲及其他国家的日子越发艰难，因此，这对我们的出口带来巨大的压力。当然，更多的不确定还是来自于通胀与战争。

这次的全球大通胀本质上还是和 70 年代的滞胀是不一样的，70 年代的滞胀很重要的因素是美国战后婴儿潮带来了总需求扩张，能源供给无法跟上需求的爆发。而这次的重要原因是新冠疫情带来全球性的供给效率下降，体现在原材料供给不足和产能建设放缓、航运效率下降以及很多行业均出现生产效率明显下降等等方面。与此同时，需求侧则因为欧美发钱的一次性刺激，消费出现不降反升的状态，进而造成了供需错配、价格上涨。然而，疫情逐步消退之后，战争与冲突又让供应链发生断裂，进一步加剧供给效率的下降，再叠加许多其他成本也同时在上升。全球化那么多年建立的最优化供应链突然被打断，临时重构的链路必然是成本相对高且低效的，这需要一段较长时间才能实现再平衡和再优化。因此，相对于货币政策，战争与冲突才是全球大通胀的最主要因素。

相对通胀而言，全球当下最大的挑战还是经济缺乏强劲的引擎。从区域角度来看，欧美国家的颓势已经难以避免，中国经济引擎的边际推动力也在逐步下降，而亚非拉的其他发展中国家仍

然看不到顶起来的趋势。新的增长引擎的缺失，伴随着的是资源的相对匮乏，这使得全球不可避免地走向各种形式地内卷。这不限于国与国之间的内卷，还包括同一国家不同区域、民族、阶层之间的内卷，这势必加大战争与冲突的可能性。

从过去的经验来看，解决内卷的最好方式一定是做大蛋糕。当我们对全球经济缺乏强劲引擎充满迷茫的时候，Chat GPT（以下简称 GPT）的横空出世让我们看到新一轮的科技革命到来的希望，GPT 有望接替当年的互联网给全球经济带来一场效率革命。Open AI 公司为全球 AI 的突破做出了杰出的贡献，当全球的 AI 公司都彷徨在瓶颈期，Chat GPT 惊艳的效果为这些 AI 公司照亮了一条进阶的道路，这毫无疑问将引导更多的科技公司投入到这新一轮的军备竞赛中。这几乎已经宣告 AI 时代的到来。

从 GPT4.0 展现出的能力，AI GPT 将替代部分重复性的白领工作已经毋庸置疑了，这犹如当年机器替代简单的体力劳动一样，简单的脑力劳动的替代也正式开始了。当然，我们不仅要看到 GPT 对部分工作的替代，更应该关注 GPT 能否创造出更多的新需求和新场景。GPT 无疑会对很多行业带来革命性变化，从 GPT4.0 发布之后，教育、金融和内容创作是 GPT 合作最多的三个场景，预计随着时间推移，GPT Plugin 嫁接的领域和应用会越来越多。GPT 冲击波将席卷几乎所有大型的互联网公司，这些互联网公司无论主动还是被动都将不得不卷入这一轮 AI 的大潮中，新一轮的算力军备竞赛毫无疑问已经开始了。

我们长期看好的方向

从长期来看，全球化进程已经遭到破坏，未来的世界增量机会在变少，存量的变化是主轴之一。同时国内经济逐步走向复苏，复苏所带来的机会是明确的。

比较明确的机会是存量结构的变化，例如燃油车向电动智能汽车的转变。我们依旧认为电动智能汽车是未来十年最精彩的赛道。因为我们知道这是一个鲜有的万亿级别的赛道，未来电动智能化的渗透率和产值还有数倍的提升空间。当然，当前锂电产业链出现一定程度的产能过剩，但是优秀的企业正在凭借自身成本优势以及优秀的管理模式，逐步的扩大份额，赚取行业的超额收益，淘汰落后产能，我们相信这些企业经历洗礼过后可以更好的享受这个大赛道的红利。在智能化方面，我们认为汽车的体验性功能配置会走向如同手机配置般的内卷，汽车会引入越来越多酷炫的功能，比如多屏联动、语音操控、车内投影等等，这将提升相关汽配企业营收的天花板。我们非常看好汽车电动化和智能化进程的加速，对未来充满期待和想象。

同时，AI 的超预期进展也将给汽车带来变革。汽车作为人工智能的产品载体之一，自身就是一个天然的应用场景。比如，智能座舱对 GPT 模型本地部署提升语音交互体验，智能驾驶通过大模型优化感知算法，减少标注工作，提升自动驾驶能力，等等，都将加速汽车智能化进程。我们

也将持续深入研究 AI+汽车领域的投资机会。

关于基金的策略容量

我们现在管理的优选、环保优势和创新成长三支基金均定位为全行业基金，主要采取之前季报所描述的企业生命力评估的方法论策略。它们不仅会投资在企业成长爆发阶段，也会有大量投资于陪伴企业成长的早中期阶段，市值分布从 30 亿至万亿不等，行业分布也较为分散，体现为多层次均衡式投资。

景顺长城成长龙头也定位为全行业基金，但是投资的企业会更偏重于大市值龙头成长股。

景顺长城公司治理基金和成长领航基金同样定位于均衡成长，但有较多仓位投资于以专精特新为代表的中小市值股票。

景顺长城改革机遇基金的持仓结构基本与公司治理、成长领航一致，唯一不同就是仓位，改革机遇的仓位预计会在 50-80%之间波动，大部分时间会在 60-70%之间。

景顺长城电子信息产业与新能源产业均是团队管理的行业型基金，分别聚焦于科技股与新能源产业。由于聚焦于科技股和新能源产业，这两个基金会体现较高的波动率。我们希望通过产业切入的方式实现持续的超额收益，并通过更专业的产业投资让投资者分享产业成长的红利。

结束语

新的一年开始了，我们希望继续努力，尽早收复失地，争取为所有持有人都能带来良好的回报，不辜负大家的期待。站在今天，我对今年的市场充满信心，我深信我们去年埋下的希望和坚持的种子一定会生根发芽，争取给持有人带来丰硕的果实。谢谢大家过去一年不离不弃的陪伴，我们努力做好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2023 年 1 季度，景顺长城新能源产业股票 A 类份额净值增长率为 2.47%，业绩比较基准收益率为-0.97%。

2023 年 1 季度，景顺长城新能源产业股票 C 类份额净值增长率为 2.44%，业绩比较基准收益率为-0.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,256,019,648.72	89.80
	其中：股票	6,256,019,648.72	89.80
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	273,177,575.34	3.92
	其中：债券	273,177,575.34	3.92
	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	367,385,045.06	5.27
8	其他资产	69,701,417.30	1.00
9	合计	6,966,283,686.42	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 150,300,355.34 元，占基金资产净值比例为 2.17%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	5,958,746,628.61	85.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	368,222.80	0.01
E	建筑业	77,329.12	0.00
F	批发和零售业	444,832.76	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,548.50	0.00
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	145,811,735.12	2.10
N	水利、环境和公共设施管理业	169,467.93	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	73,528.54	0.00
R	文化、体育和娱乐业	—	—

S	综合	-	-
	合计	6,105,719,293.38	88.06

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	56,133,302.64	0.81
非周期性消费品	-	-
综合	-	-
能源	-	-
金融	-	-
基金	-	-
工业	94,167,052.70	1.36
信息科技	-	-
公用事业	-	-
通讯	-	-
合计	150,300,355.34	2.17

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,380,191	560,426,555.55	8.08
2	689009	九号公司	12,958,280	487,749,659.20	7.03
3	300207	欣旺达	20,103,965	405,295,934.40	5.85
4	002472	双环传动	14,208,977	373,997,656.31	5.39
5	600460	士兰微	10,049,791	371,942,764.91	5.36
6	688116	天奈科技	4,654,294	315,188,789.68	4.55
7	002126	银轮股份	20,947,733	298,924,149.91	4.31
8	300568	星源材质	14,276,111	274,672,375.64	3.96
9	002906	华阳集团	8,133,337	271,328,122.32	3.91
10	603197	保隆科技	6,641,717	269,321,624.35	3.88

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	273,177,575.34	3.94
	其中：政策性金融债	203,058,575.34	2.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	273,177,575.34	3.94

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	220206	22 国开 06	2,000,000	203,058,575.34	2.93
2	2320005	23 厦门国际银行 三农债 01	700,000	70,119,000.00	1.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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

山西华阳集团新能股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到寿阳县交通运输局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	790,109.29
2	应收证券清算款	63,551,550.00
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	5,359,758.01
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	69,701,417.30

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产	流通受限情况说
----	------	------	-------------	-------	---------

			(元)	净值比例 (%)	明
1	002472	双环传动	47,020,120.88	0.68	非公开流通受限

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城新能源产业股票 A 类	景顺长城新能源产业股票 C 类
报告期期初基金份额总额	2,154,460,829.06	3,804,586,450.87
报告期期间基金总申购份额	96,179,168.98	412,037,145.80
减：报告期期间基金总赎回份额	113,337,760.58	402,504,207.57
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	2,137,302,237.46	3,814,119,389.10

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城新能源产业股票型证券投资基金募集注册的文件；

- 2、《景顺长城新能源产业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城新能源产业股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城新能源产业股票型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。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 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

2023 年 4 月 21 日