

长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资
基金（QDII-LOF）
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 04 月 21 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
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 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	18
4.10 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.....	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	22
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24

§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	51
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	51
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	51
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	53
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	57
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	57
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	57
8.11 投资组合报告附注.....	57
§9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	59
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.....	59
9.6 发起式基金发起资金持有份额情况.....	59
§10 开放式基金份额变动	59
§11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
11.4 基金投资策略的改变.....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
11.8 其他重大事件.....	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息	63
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.....	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§13 备查文件目录	64
13.1 备查文件目录.....	64
13.2 存放地点.....	64
13.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）	
基金简称	长城全球新能源车股票发起式（QDII）	
场内简称	全球电车、新能源车全球 LOF	
基金主代码	501226	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2023 年 4 月 21 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	16,571,343.56 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2023 年 4 月 24 日	
下属分级基金的基金简称	长城全球新能源车股票发起式（QDII） A	长城全球新能源车股票发起式（QDII） C
下属分级基金的交易代码	501226	018036
报告期末下属分级基金的份额总额	11,358,595.36 份	5,212,748.20 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资全球新能源汽车主题相关上市公司，在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>2、股票（含存托凭证）投资策略</p> <p>本基金主要采取“自下而上”的选股策略，依据约定的投资范围，通过定量筛选和基本面分析，挑选出符合全球新能源汽车主题定义的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>（1）主题界定</p> <p>本基金所指的全球新能源汽车主题由主营业务涉及新能源汽车产业领域涉及的具备高技术、高附加值的先进工业设施设备的行业以及围绕上述行业提供原材料、服务和产品的行业组成。</p> <p>具体来讲，全球新能源汽车主题涉及的上市公司主要分布在下述几个细分产业链条：</p> <p>1) 全球新能源汽车产业链上游，包括提供制氢、氢气储运、锂矿、</p>

	<p>电解液、工业金属、正负极材料、隔膜、汽车轻量化材料制造、研发业务的公司；</p> <p>2) 全球新能源汽车产业链中游，包括提供电池设备、电芯电池组、BMS 电池系统、电控系统、电动机、发动机热管理系统、汽车驾驶系统、智能交互系统、燃料电池系统、质子交换膜、激光雷达、车载摄像头、电路系统制造、研发、运营、维护业务的公司；</p> <p>3) 全球新能源汽车产业链下游，包括提供充电桩运营、加氢站运营、整车制造、研发、销售、维修保养业务的公司。</p> <p>本基金将对影响全球新能源汽车主题涵盖范围的因素进行持续跟踪研究，在履行适当程序后，适时对全球新能源汽车主题的涵盖范围进行动态调整，并在更新的招募说明书中公告。</p> <p>(2) 个股投资策略</p> <p>本基金秉承公司的投资理念，主要投资于优选行业中的绩优股票。具体操作上，主要采取“自下而上”的选股策略。通过定量筛选和定性分析，挑选出高性价比的上市公司股票进行投资，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。</p> <p>(3) 港股通标的投资策略</p> <p>本基金同时关注互联互通机制下港股市场优质标的的投资机会。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>4、金融衍生品投资策略</p> <p>本基金可以参与股指期货交易，但必须根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金投资于国债期货，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股票期权交易。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。</p> <p>6、融资业务策略</p> <p>为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可根据相关法律法规，参与融资业务。</p>
业绩比较基准	<p>彭博全球新能源汽车指数收益率 (Bloomberg Electric Vehicles Index, 使用估值汇率折算) ×95%+人民币活期存款利率(税后)×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p>

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	长城基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张姗
	联系电话	0755-83077987
	电子邮箱	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	400-8868-666	95555
传真	0755-29279000	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	518046	518040
法定代表人	王军	缪建民

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Citibank, N.A. Hong Kong
	中文	-	美国花旗银行有限公司
注册地址		-	701 East 60th Street North, Sioux Falls, SD57104, USA
办公地址		-	G/F, 21/F & 23/F, Citi Tower, One Bay East, 83 Hoi Bun Road, Ngau Tau Kok, HongKong
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 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）	上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39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	2023年4月21日(基金合同生效日)-2023年12月31日	
	长城全球新能源车股票发起式（QDII）A	长城全球新能源车股票发起式（QDII）C

本期已实现收益	-126,518.76	-202,439.52
本期利润	1,779,923.06	-48,204.22
加权平均基金份额本期利润	0.1611	-0.0135
本期加权平均净值利润率	14.29%	-1.20%
本期基金份额净值增长率	16.97%	16.53%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
期末可供分配利润	-108,472.69	-73,834.71
期末可供分配基金份额利润	-0.0095	-0.0142
期末基金资产净值	13,285,816.19	6,074,599.02
期末基金份额净值	1.1697	1.1653
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	16.97%	16.53%

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交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

③“期末可供分配利润”的计算方法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。

④本基金合同于 2023 年 4 月 21 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

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

长城全球新能源车股票发起式（QDII）A

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

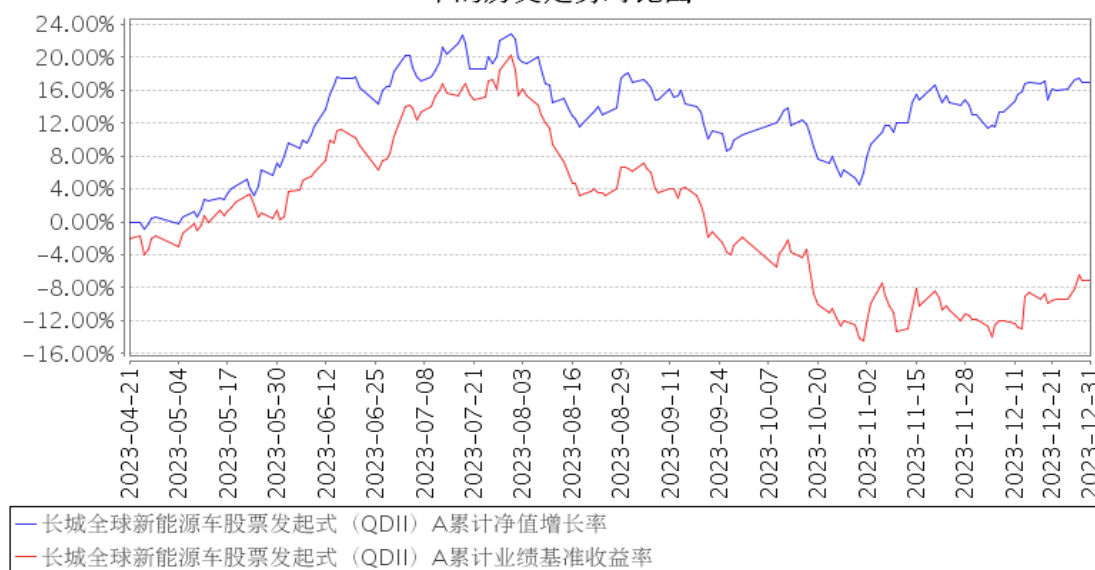
	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	5.86%	0.94%	-5.30%	1.58%	11.16%	-0.64%
过去六个月	-1.02%	0.99%	-15.90%	1.37%	14.88%	-0.38%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	16.97%	0.97%	-7.09%	1.33%	24.06%	-0.36%

长城全球新能源车股票发起式（QDII）C

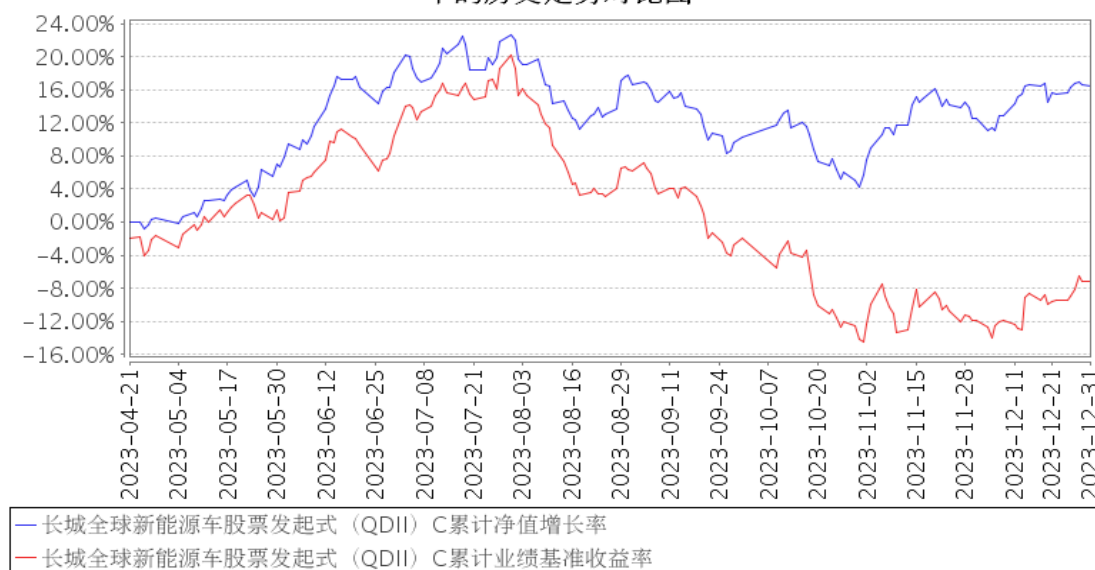
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.74%	0.94%	-5.30%	1.58%	11.04%	-0.64%
过去六个月	-1.28%	0.99%	-15.90%	1.37%	14.62%	-0.38%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	16.53%	0.97%	-7.09%	1.33%	23.62%	-0.36%

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

长城全球新能源车股票发起式（QDII）A 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



长城全球新能源车股票发起式（QDII）C 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：①本基金投资组合中股票资产（含普通股、优先股、境内存托凭证、全球存托凭证、美国存托凭证等）投资比例为基金资产的 80%-95%，投资于本基金界定的全球新能源汽车主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金投资于境外市场的资产占基金资产的比例不低于 20%，本基金投资于境内市场的资产占基金资产的比例不低于 20%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；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。本基金可投资全球市场，包括境内市场和境外不同国家或地区市场，本基金投资于境外

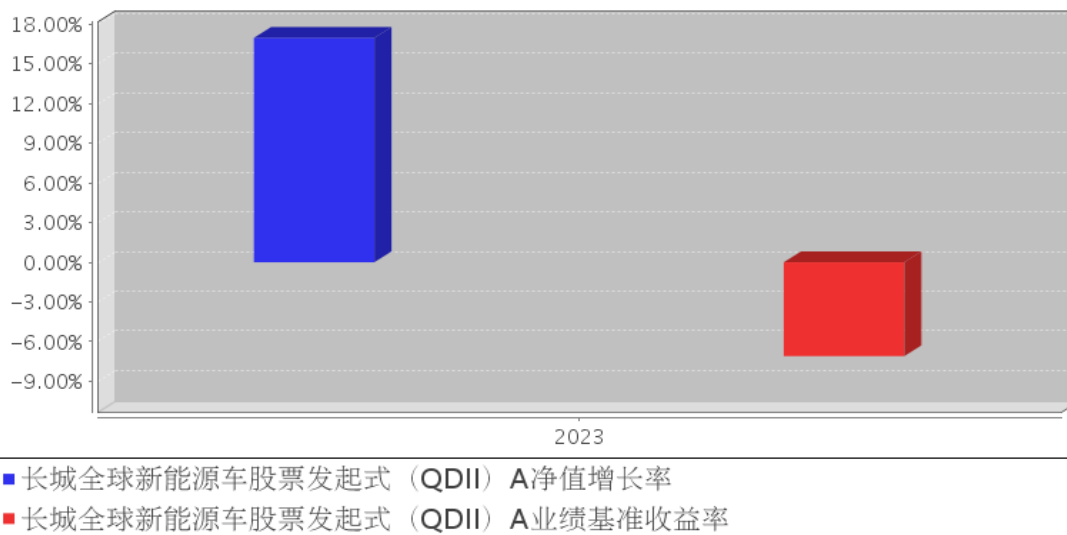
市场的资产占基金资产的比例不低于 20%，本基金投资于境内市场的资产占基金资产的比例不低于 20%，可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港市场。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

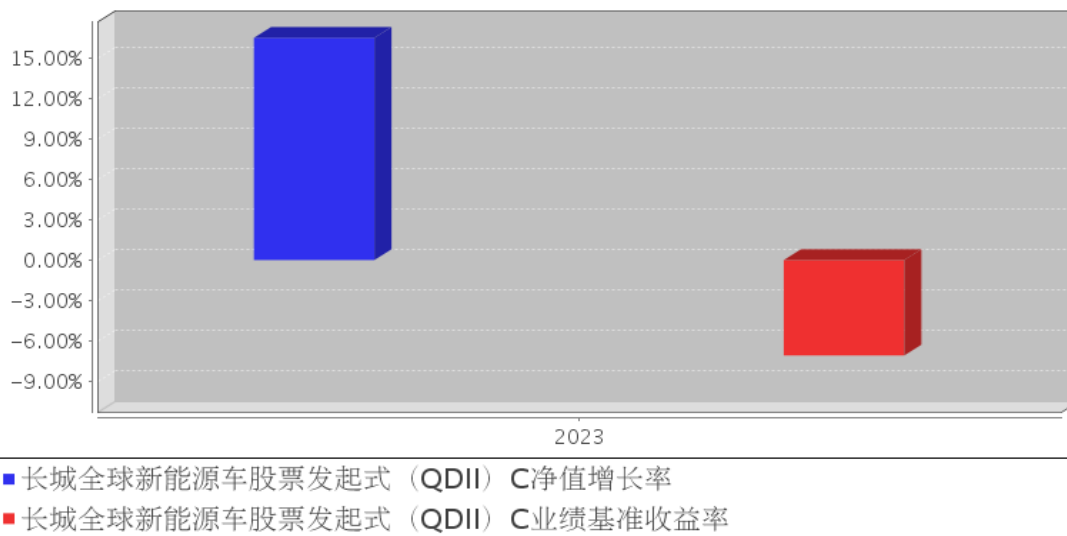
③本基金合同于 2023 年 4 月 21 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

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

长城全球新能源车股票发起式（QDII）A 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



长城全球新能源车股票发起式（QDII）C 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：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理的基金有：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城悦享增利债券型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证

券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城新能源股票型发起式证券投资基金、长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金、长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金、长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金、长城瑞利纯债债券型证券投资基金、长城产业成长混合型证券投资基金、长城产业趋势混合型证券投资基金、长城远见成长混合型证券投资基金、长城聚利纯债债券型证券投资基金、长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长城永利债券型证券投资基金、长城数字经济混合型证券投资基金、长城鑫利 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业臻选混合型证券投资基金、长城鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）、长城创新成长混合型证券投资基金、长城锦利三个月定期开放债券型证券投资基金、长城裕利纯债债券型发起式证券投资基金、长城景气成长混合型证券投资基金、长城集利债券型发起式证券投资基金、长城国企优选混合型发起式证券投资基金、长城精选进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城均衡成长混合型证券投资基金、长城智盈添益债券型发起式证券投资基金。

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		
曲少杰	国际业务部总经理助理（主持工作）、本基金的基金经理	2023 年 4 月 21 日	-	17 年	男，中国籍，硕士，特许金融分析师（CFA）。2006 年 6 月-2012 年 6 月曾就职于易方达基金管理有限公司任 QDII 交易经理，2014 年 4 月-2015 年 4 月曾就职于 YGD 资产管理公司（香港）任港股投资经理，2015 年 4 月-2016 年 10 月曾就职于深圳道朴资本管理有限公司任投资经理，2016 年 10 月-2018 年 3 月曾就职于生命保险资产管理有限公司任港股投资经理。2018 年 3 月加入长城基金管理有限公司，历任港股研究员，现任国际业务部总经理助理（主持工作）。自 2019 年 6 月至今任“长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 4 月至今任“长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）”基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

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

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，同一组合经理管理的多个投资组合的不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制同一组合经理管理的多个投资组合的同日反向交易，对同向交易的价差进行强化的监测和事后分析，对不同时间窗的（同日、3 日内、5 日内、7 日内、9 日内、11 日内、13 日内）同向交易和临近交易日的反向交易价差进行监控分析，并结成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下同一组合经理管理的多个投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金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% 的现象。

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

2023 年以来国内新能源车渗透率继续提升，其中 11 月份渗透率首次超过了 40%，成为汽车电动化发展的重要里程碑。美国新能源车渗透率达到 10%，增速超过了中国和欧洲，仍然具有非常大的提升空间。欧洲 12 国 1-11 月新能源车累计销量 219.9 万辆，累计同比+17%，累计渗透率 22.5%，同比增加 0.5%，距离 2030 年停止销售化石能源车仍有巨大的渗透率提升空间。我们判断 2024 年国内新能源乘用车（不含出口）销量有望突破 950 万辆，同比增长 20%左右；欧洲 2024 年新能源车销量继续提升，2025 年是欧洲碳排放考核的大年，需求预计恢复至 30%以上的增长；美国 2024 年的新能源车产销保持高速增长，同比增速维持在 30%左右，2023 年是智能驾驶元年，智能驾驶技术受到越来越多消费者的关注，智能驾驶技术持续演进，主要整车厂将智能

驾驶作为了主要竞争阵地。L2 级别在新能源车上的渗透率逐步提升，L3 也将更多的被消费者接受，智能驾驶芯片和智能座舱芯片、摄像头、激光雷达、毫米波雷达、域控制器、中控屏、音响等硬件设备厂成长性被打开，智能驾驶软件进一步借助人工智能大模型提升演进速度。展望 2024 年，智能驾驶仍然将会是新能源车的兵家必争之地，软件和硬件都将以更快的速度迭代从而产生很多投资机会。本基金所投资于全球新能源整车龙头企业，和智能驾驶芯片、智能座舱芯片为代表的智能驾驶配套产业链公司，将持续受益于全球新能源汽车的销量提升和智能驾驶的加速普及。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城全球新能源车股票发起式（QDII）A 基金份额净值为 1.1697 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.97%，同期业绩比较基准收益率为-7.09%；

截至本报告期末长城全球新能源车股票发起式（QDII）C 基金份额净值为 1.1653 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.53%，同期业绩比较基准收益率为-7.09%。

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 2024 年，我们坚定看好全球新能源车加速渗透，电动车具有动力强劲、节能环保、智能化等优势，更多的新车购买者会倾向于买更加智能化的电动车而非传统燃油车；随着电池技术和充电技术的进步，电动车充电效率将大大提高，加快消费者购买电动车的意愿；智能驾驶已经进入“奇点”时刻，年轻一代买车会更多考虑智能驾驶的级别和车内智能座舱娱乐交互功能，L3 级别的智能驾驶将加速普及，L4 级别的智能驾驶已经看到曙光。看好全球新能源汽车整车及产业链龙头企业和已经抢跑占领智能驾驶和智能座舱领导地位的公司以及布局智能驾驶大模型的产业链公司。

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，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“规范、专业、高效、拼搏”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，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，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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(2024)第 27664 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	长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF) (以下简称“长城全球新能源车股票发起式(QDII)基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。 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

	<p>业实务操作编制，公允反映了长城全球新能源车股票发起式（QDII）基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</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，我们独立于长城全球新能源车股票发起式（QDII）基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	不适用
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>长城全球新能源车股票发起式（QDII）基金的基金管理人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长城全球新能源车股票发起式（QDII）基金的持续经营能力，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长城全球新能源车股票发起式（QDII）基金、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长城全球新能源车股票发起式（QDII）基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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</p>

	<p>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，就可能对导致对长城全球新能源车股票发起式（QDII）基金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长城全球新能源车股票发起式（QDII）基金不能持续经营。</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的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
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	张炯	肖菊
会计师事务所的地址	中国 上海	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	2,815,207.54
结算备付金		7,352.88
存出保证金		1,727.12
交易性金融资产	7.4.7.2	16,767,911.85
其中：股票投资		16,767,911.85
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		5,910.16
应收申购款		96,108.04
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		19,694,217.59
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日
负债：		
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		-
应付清算款		0.29
应付赎回款		266,581.37
应付管理人报酬		24,455.24
应付托管费		4,075.85
应付销售服务费		3,119.90
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	35,569.73
负债合计		333,802.38
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	16,571,343.56
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	2,789,071.65
净资产合计		19,360,415.21
负债和净资产总计		19,694,217.59

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 16,571,343.56 份，其中长城全球新能源车股票发起式（QDII）A 类基金份额净值 1.1697 元，基金份额 11,358,595.36 份；长城全球新能源车股票发起式（QDII）C 类基金份额净值 1.1653 元，基金份额 5,212,748.20 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 4 月 21 日（基金合同 生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,985,356.27
1. 利息收入		4,735.36
其中：存款利息收入	7.4.7.13	4,735.36
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-122,313.72
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-209,622.40
基金投资收益	7.4.7.15	-
债券投资收益	7.4.7.16	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.17	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-
股利收益	7.4.7.20	87,308.68
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	2,060,677.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		7,970.11
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	34,287.40
减：二、营业总支出		253,637.43
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	171,559.09
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	28,593.13
3. 销售服务费		16,739.15
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.23	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.24	36,746.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		1,731,718.84

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,731,718.84
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,731,718.84

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）

本报告期：2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	11,429,036.06	-	-	11,429,036.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,142,307.50	-	2,789,071.65	7,931,379.15
（一）、综合收益总额	-	-	1,731,718.84	1,731,718.84
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	5,142,307.50	-	1,057,352.81	6,199,660.31
其中：1. 基金申购款	14,295,069.61	-	2,307,849.14	16,602,918.75
2. 基金赎回款	-9,152,762.11	-	-1,250,496.33	-10,403,258.44
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产	16,571,343.56	-	2,789,071.65	19,360,415.21

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：

<u>王军</u>	<u>邱春杨</u>	<u>赵永强</u>
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

长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)(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[2023]208号《关于准予长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)注册的批复》核准,由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《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、上市开放式、发起式,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11,428,987.69元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2023)验字第60737541_H06号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》于2023年4月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,429,036.06份,其中认购资金利息折合48.37份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(“招商银行”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,000.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金份额时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购/申购基金份额时不收取认购/申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为于境内市场和境外市场依法发行的金融工具。境内市场投资工具包括国内依法发行或上市的股票(包含主板股票、创业板股票及其他

经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换公司债券（含可分离交易的可转换公司债券的纯债部分）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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、现金、金融衍生品（包含股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他境内金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金（含交易型开放式指数基金 ETF）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、港股通标的股票、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品。本基金可以进行境外证券借贷交易、境外正回购交易、逆回购交易。有关证券借贷交易的内容以专门签署的三方或多方协议约定为准。

本基金投资组合比例为：股票资产（含普通股、优先股、境内存托凭证、全球存托凭证、美国存托凭证等）占基金资产的比例为 80%-95%，投资于本基金界定的全球新能源汽车主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；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。本基金可投资全球市场，包括境内市场和境外不同国家或地区市场，本基金投资于境外市场的资产占基金资产的比例不低于 20%，本基金投资于境内市场的资产占基金资产的比例不低于 20%，可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制投资香港市场。

本基金的业绩比较基准为：彭博全球新能源汽车指数收益率（Bloomberg Electric Vehicles Index，使用估值汇率折算） $\times 95\%$ +人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人长城基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（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》、《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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 2023 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2023 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产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。本财务报表的实际编制期间为 2023 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,

仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。

金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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、债券投资和资产支持证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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额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扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的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

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于 2024 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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[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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通或深港通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) 基金通过沪港通/深港通买卖、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 2023年12月31日
活期存款	2,815,207.54
等于：本金	2,814,903.80
加：应计利息	303.74
减：坏账准备	-

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,815,207.54

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	14,707,234.73	-	16,767,911.85	2,060,677.12
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	14,707,234.73	-	16,767,911.85	2,060,677.12

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

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

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	42.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,527.54
其中：交易所市场	8,527.54
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	27,000.00
合计	35,569.73

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城全球新能源车股票发起式（QDII）A

项目	本期 2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,667,913.75	10,667,913.75
本期申购	1,865,244.02	1,865,244.02
本期赎回（以“-”号填列）	-1,174,562.41	-1,174,562.41
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	11,358,595.36	11,358,595.36

长城全球新能源车股票发起式（QDII）C

项目	本期 2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	761,122.31	761,122.31
本期申购	12,429,825.59	12,429,825.59
本期赎回（以“-”号填列）	-7,978,199.70	-7,978,199.70
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	5,212,748.20	5,212,748.20

注：1. 申购含红利再投、转换入份额(如有)；赎回含转换出份额(如有)。

2. 本基金自 2023 年 4 月 13 日至 2023 年 4 月 19 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 11,428,987.69 元。根据《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 48.37 元在本基金成立后，折算为 48.37 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金(QDII-LOF)开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2023 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2023 年 7 月 19 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回和定期定额投资业务自 2023 年 7 月 20 日起开始办理。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城全球新能源车股票发起式（QDII）A

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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-126,518.76	1,906,441.82	1,779,923.06
本期基金份额交易产生的变动数	18,046.07	129,251.70	147,297.77
其中：基金申购款	34,202.57	278,902.89	313,105.46
基金赎回款	-16,156.50	-149,651.19	-165,807.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-108,472.69	2,035,693.52	1,927,220.83

长城全球新能源车股票发起式（QDII）C

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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-202,439.52	154,235.30	-48,204.22
本期基金份额交易产生的变动数	128,604.81	781,450.23	910,055.04
其中：基金申购款	240,519.88	1,754,223.80	1,994,743.68
基金赎回款	-111,915.07	-972,773.57	-1,084,688.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-73,834.71	935,685.53	861,850.82

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	4,032.28
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	688.19
其他	14.89
合计	4,735.36

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-209,622.40
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-209,622.40

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	12,532,114.83
减：卖出股票成本总额	12,697,138.92
减：交易费用	44,598.31
买卖股票差价收入	-209,622.40

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 基金投资收益

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	87,308.68
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	87,308.68

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日

1. 交易性金融资产	2,060,677.12
股票投资	2,060,677.12
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	2,060,677.12

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	34,287.40
合计	34,287.40

7.4.7.23 信用减值损失

注：无。

7.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	27,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	9,657.75
深港通_证券组合费	88.31
合计	36,746.06

7.4.7.25 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
美国花旗银行有限公司（“花旗银行”）	境外托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
中原信托有限公司	基金管理人的股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
长城嘉信资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
长城证券	8,704,442.10	38.63
东方证券	5,739,248.00	25.47

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 基金交易

注：无。

7.4.10.1.5 权证交易

注：无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
东方证券	5,344.97	26.77	-	-
长城证券	6,963.56	34.88	1,919.13	22.51

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和证券交易所买（卖）证管费等）。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	171,559.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,327.23
应支付基金管理人的净管理费	149,231.86
应支付投资顾问的投资顾问费	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年4月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	28,593.13

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 \times 0.25% / 当年天数。基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城全球新能源车股票发起式（QDII）A	长城全球新能源车股票发起式（QDII）C	合计
招商银行	-	892.05	892.05
合计	-	892.05	892.05

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.6%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.6% 年费率计提。计算公式如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
	长城全球新能源车股票发起式（QDII）A	长城全球新能源车股票发起式（QDII）C
基金合同生效日（2023 年 4 月 21 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	60.3451%	-

注：基金管理人合同生效日持有本基金份额变动相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算。

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

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末未持有本基金份额。

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	
	2023 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
花旗银行	121,922.02	147.65
招商银行	2,693,285.52	3,884.63

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的利润分配情况，请参阅本财务报表

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2023 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

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金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为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金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为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由风险控制委员会，投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金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证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易

对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无债券投资。

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基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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%。于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有流动性受限资产。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 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。于 2023 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

7.4.13.4 市场风险

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

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受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

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公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
货币资金	2,815,207.54	-	-	-	-	-	2,815,207.54
结算备付金	7,352.88	-	-	-	-	-	7,352.88
存出保证金	1,727.12	-	-	-	-	-	1,727.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	16,767,911.85	16,767,911.85
应收股利	-	-	-	-	-	5,910.16	5,910.16
应收申购款	-	-	-	-	-	96,108.04	96,108.04
资产总计	2,824,287.54	-	-	-	-	16,869,930.05	19,694,217.59
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	266,581.37	266,581.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,455.24	24,455.24
应付托管费	-	-	-	-	-	4,075.85	4,075.85
应付清算款	-	-	-	-	-	0.29	0.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,119.90	3,119.90
其他负债	-	-	-	-	-	35,569.73	35,569.73
负债总计	-	-	-	-	-	333,802.38	333,802.38
利率敏感度缺口	2,824,287.54	-	-	-	-	-	

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末未持有交易性债券投资。因此在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可

能变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末基金资产净值无重大影响。本基金基金合同于 2023 年 4 月 21 日生效，无上年度末比较数据。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	121,922.02	-	-	121,922.02
交易性金融资产	13,988,732.67	1,346,099.18	-	15,334,831.85
应收股利	5,910.16	-	-	5,910.16
资产合计	14,116,564.85	1,346,099.18	-	15,462,664.03
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	14,116,564.85	1,346,099.18	-	15,462,664.03

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币均相对人民币升值 5%	67,304.96

	所有外币均相对人民币贬值 5%	-67,304.96
--	-----------------	------------

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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。

本基金投资组合比例为：股票资产(含普通股、优先股、境内存托凭证、全球存托凭证、美国存托凭证等)占基金资产的比例为 80%-95%，投资于本基金界定的全球新能源汽车主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；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。

本基金于本期末面临的整体其他价格风险列示如下。本基金合同于 2023 年 4 月 21 日生效，因此无上年度可比期间数据。

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 2023 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	16,767,911.85	86.61
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	16,767,911.85	86.61

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	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2023 年 12 月 31 日）

沪深 300 指数上升 5%	842,839.09
沪深 300 指数下降 5%	-842,839.09

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	16,767,911.85
第二层次	-
第三层次	-
合计	16,767,911.85

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况**7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

注：本基金于本期初及上年度期初均未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金于本期及上年度可比期间均未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	16,767,911.85	85.14
	其中：普通股	15,663,010.65	79.53
	存托凭证	1,104,901.20	5.61
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,822,560.42	14.33

8	其他各项资产	103,745.32	0.53
9	合计	19,694,217.59	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	13,988,732.67	72.25
中国大陆	1,433,080.00	7.40
中国香港	1,346,099.18	6.95
合计	16,767,911.85	86.61

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	4,222,837.18	21.81
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	460,600.00	2.38
H 信息技术	10,699,339.36	55.26
I 电信服务	1,385,135.31	7.15
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	16,767,911.85	86.61

注：以上分类采用财汇和彭博提供的国际通用行业分类标准。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	纳斯达克交易所	美国	210	1,660,273.41	8.58
2	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克交易所	美国	600	1,598,027.10	8.25
3	TESLA INC	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克交易所	美国	900	1,583,918.37	8.18
4	NVIDIA	英伟达	NVDA US	纳斯达克	美国	450	1,578,372.61	8.15

	CORP			克交易所				
5	ALPHABET INC-CL A	Alphabet 公司	GOOGL US	纳斯达克交易所	美国	1,400	1,385,135.31	7.15
6	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克交易所	美国	900	1,227,269.01	6.34
7	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	台积电	TSM US	美国纽约证券交易所	美国	1,500	1,104,901.20	5.71
8	ON SEMICONDUCTOR	安森美半导体公司	ON US	纳斯达克交易所	美国	1,700	1,005,750.48	5.19
9	Li Auto Inc	理想汽车	2015 HK	深港通联合市场	中国香港	7,000	933,134.73	4.82
10	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	纳斯达克交易所	美国	800	835,248.65	4.31
11	NXP SEMICONDUCTORS NV	恩智浦半导体公司	NXPI US	纳斯达克交易所	美国	500	813,377.27	4.20
12	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	纳斯达克交易所	美国	700	717,059.63	3.70
13	Bethel Automotive Safety Systems Co., Ltd.	伯特利	603596 SH	上海证券交易所	中国大陆	8,000	554,400.00	2.86
14	FERRARI NV	法拉利	RACE US	美国纽约证券交易所	美国	200	479,399.63	2.48
15	Weichai Power Co., Ltd.	潍柴动力	000338 SZ	深圳证券交易所	中国大陆	20,000	273,000.00	1.41
16		德赛西	002920	深圳证	中国	2,000	259,020.00	1.34

	Huizhou Desay Sv Automotive Co., Ltd.	威	SZ	券交易所	大陆			
17	Zhejiang Leapmotor Technology Co., Ltd.	零跑汽车	9863 HK	深港通联合市场	中国香港	8,000	258,816.43	1.34
18	Cimc Vehicles (Group) Co., Ltd.	中集车辆	301039 SZ	深圳证券交易所	中国大陆	20,000	187,600.00	0.97
19	Semiconductor Manufacturing International Corporation	中芯国际	688981 SH	上海证券交易所	中国大陆	3,000	159,060.00	0.82
20	Xpeng Inc.	小鹏汽车	9868 HK	深港通联合市场	中国香港	3,000	154,148.02	0.80

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	Contemporary Amperex Technology Co., Ltd.	300750 SZ	1,506,555.00	7.78
2		2015 HK	1,430,183.55	7.39

	Li Auto Inc.			
3	MICROSOFT CORP	MSFT US	1,393,100.64	7.20
4	TESLA INC	TSLA US	1,378,819.07	7.12
5	ON SEMICONDUCTOR	ON US	1,251,070.24	6.46
6	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	1,220,986.95	6.31
7	NVIDIA CORP	NVDA US	1,203,239.56	6.21
8	BROADCOM INC	AVGO US	1,168,563.86	6.04
9	APPLE INC	AAPL US	1,105,556.32	5.71
10	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	TSM US	1,051,500.49	5.43
11	Xiaomi Corporation	1810 HK	981,511.06	5.07
12	Xpeng Inc.	9868 HK	954,152.35	4.93
13	QUALCOMM INC	QCOM US	948,682.50	4.90
14	Byd Company Limited	002594 SZ	883,270.00	4.56
15	Anhui Jianghuai Automobile Group Corp.,Ltd.	600418 SH	841,310.00	4.35
16	INFINEON TECHNOLOGIES AG	IFX GR	810,377.03	4.19
17	NXP SEMICONDUCTORS NV	NXPI US	738,658.89	3.82
18	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	701,643.01	3.62
19	Bethel Automotive Safety Systems Co.,Ltd.	603596 SH	650,530.00	3.36
20	Yunnan Energy New Material Co.,Ltd.	002812 SZ	611,389.00	3.16
21	Nexteer Automotive	1316 HK	595,867.18	3.08

	Group Limited			
22	Huizhou Desay Sv Automotive Co.,Ltd.	002920 SZ	543,166.00	2.81
23	Zhejiang Leapmotor Technology Co., Ltd.	9863 HK	435,030.67	2.25
24	Cambricon Technologies Corporation Limited	688256 SH	421,500.00	2.18
25	Zhejiang Huayou Cobalt Co.,Ltd.	603799 SH	408,688.00	2.11
26	FERRARI NV	RACE US	406,031.18	2.10
27	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	BMW GR	401,439.39	2.07

8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	Contemporary Amperex Technology Co.,Ltd.	300750 SZ	1,322,691.00	6.83
2	Xiaomi Corporation	1810 HK	1,059,254.08	5.47
3	Xpeng Inc.	9868 HK	857,806.81	4.43
4	Anhui Jianghuai Automobile Group Corp.,Ltd.	600418 SH	846,450.00	4.37
5	Byd Company Limited	002594 SZ	807,438.00	4.17

6	INFINEON TECHNOLOGIES AG	IFX GR	764,259.01	3.95
7	Li Auto Inc.	2015 HK	690,686.69	3.57
8	Yunnan Energy New Material Co.,Ltd.	002812 SZ	535,013.00	2.76
9	Nexteer Automotive Group Limited	1316 HK	520,393.57	2.69
10	QUALCOMM INC	QCOM US	443,431.26	2.29
11	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	BMW GR	396,520.03	2.05
12	Cambricon Technologies Corporation Limited	688256 SH	384,247.07	1.98
13	Zhejiang Huayou Cobalt Co.,Ltd.	603799 SH	376,540.00	1.94
14	Sensetime Group Inc.	20 HK	365,654.36	1.89
15	Huizhou Desay Sv Automotive Co.,Ltd.	002920 SZ	296,870.00	1.53
16	Great Wall Motor Company Limited	601633 SH	271,549.00	1.40
17	TESLA INC	TSLA US	270,112.15	1.40
18	Ningbo Tuopu Group Co.,Ltd.	601689 SH	268,934.00	1.39
19	DR ING HC F PORSCHE AG	P911 GR	259,232.34	1.34
20	INTC US	INTC US	256,588.18	1.33

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	27,404,373.65
------------	---------------

卖出收入（成交）总额	12,532,114.83
------------	---------------

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：无。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

注：无。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：无。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

8.11.2 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中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.11.3 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	1,727.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	5,910.16
4	应收利息	-
5	应收申购款	96,108.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	103,745.32

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
长城全球新能源车股票发起式（QDII）A	380	29,891.04	10,000,000.00	88.04	1,358,595.36	11.96
长城全球新能源车股票发起式（QDII）C	2,340	2,227.67	-	-	5,212,748.20	100.00
合计	2,720	6,092.41	10,000,000.00	60.35	6,571,343.56	39.65

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末上市基金前十名持有人

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长城全球新能源车股票发起式（QDII）A	8,434.32	0.0743
	长城全球新能源车股票发起式（QDII）C	177,829.54	3.4114
	合计	186,263.86	1.1240

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长城全球新能源车股票发起式（QDII）A	0~10
	长城全球新能源车股票发起式（QDII）C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长城全球新能源车股票发起式（QDII）A	0~10
	长城全球新能源车股票发起式（QDII）C	10~50
	合计	10~50

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

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的情况

注：本报告期无基金经理兼任投资经理的情况。

9.6 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	60.35	10,000,000.00	60.35	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	60.35	10,000,000.00	60.35	3年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城全球新能源车股票发起式（QDII）A	长城全球新能源车股票发起式（QDII）C
基金合同生效日（2023年4月21日）基金份额总额	10,667,913.75	761,122.31

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,865,244.02	12,429,825.59
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,174,562.41	7,978,199.70
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	11,358,595.36	5,212,748.20

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人重大人事变动：

自 2023 年 2 月 6 日起，张勇先生担任公司副总经理。

自 2023 年 4 月 10 日起，何小乐女士担任公司副总经理。

自 2023 年 9 月 15 日起，车君女士担任公司副总经理，不再担任公司督察长。

自 2023 年 9 月 15 日起，祝函先生担任公司督察长。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

在本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
长城证券	2	8,704,442.10	38.63	6,963.56	34.88	-
中信证券	2	8,092,045.07	35.91	7,654.24	38.34	-
东方证券	2	5,739,248.00	25.47	5,344.97	26.77	-
第一创业	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止报告期末共 17 个交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询
服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管

人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日

2	长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 1 日
3	长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 18 日
4	长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）暂停申购、赎回、定期定额投资公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 9 月 2 日
5	长城基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 9 月 4 日
6	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 9 月 16 日
7	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 7 日
8	长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）2023 年境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 21 日
9	长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 23 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230421-20231231	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	60.3451
产品特有风险							
<p>如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：</p> <p>1、流动性风险 本基金在短期内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；</p> <p>2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险 若持有基金份额比例达到或超过 20%的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p>							

3、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要, 可能使基金资产净值受到不利影响; 另一方面, 由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响, 大额赎回可能导致基金净值出现较大波动;

4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小, 可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;

5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 根据基金合同的约定, 将面临合同终止财产清算或转型风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金托管协议》
- (四) 《长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅, 如有疑问, 可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话: 0755-29279188

客户服务电话: 400-8868-666

网站: www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日