

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
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 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：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经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 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 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 信息披露方式 | 7 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 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 其他指标 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 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 | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 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 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 37 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 37 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 40 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 41 |

| | |
|---|-----------|
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 42 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 42 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 42 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 42 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 42 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 42 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 42 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 43 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 43 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 44 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 44 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 44 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 44 |
| § 10 重大事件揭示 | 45 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 45 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 45 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 45 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 45 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 45 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 45 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 45 |
| 10.8 其他重大事件 | 46 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 48 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 48 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 48 |
| § 12 备查文件目录 | 48 |
| 12.1 备查文件目录 | 48 |
| 12.2 存放地点 | 48 |
| 12.3 查阅方式 | 48 |

§ 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 | 675,931,891.00 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，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</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>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 负责人 | 姓名 | 杨崑阳 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com |
| 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 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2024年1月1日-2024年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -58,078,573.73 |
| 本期利润 | -45,927,724.12 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0628 |
| 本期加权平均净值利润率 | -13.46% |
| 本期基金份额净值增长率 | -11.76% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | -378,264,286.39 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.5596 |
| 期末基金资产净值 | 297,667,604.61 |
| 期末基金份额净值 | 0.4404 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -55.96% |

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、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。

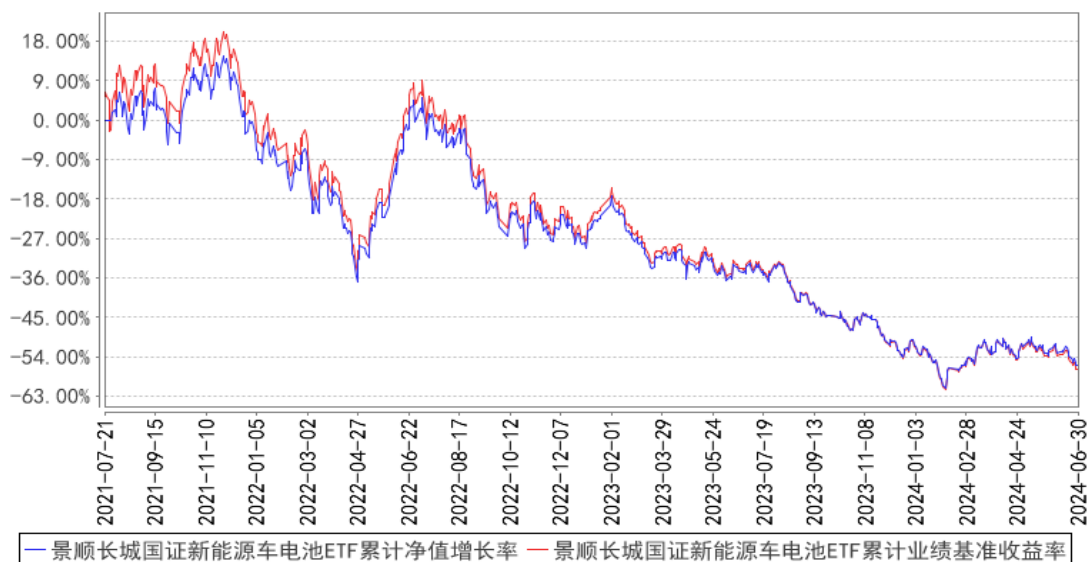
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -7.73% | 1.32% | -8.26% | 1.32% | 0.53% | 0.00% |
| 过去三个月 | -6.66% | 1.81% | -7.95% | 1.84% | 1.29% | -0.03% |
| 过去六个月 | -11.76% | 2.08% | -12.94% | 2.10% | 1.18% | -0.02% |
| 过去一年 | -33.80% | 1.76% | -35.63% | 1.78% | 1.83% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -55.96% | 2.03% | -56.72% | 2.13% | 0.76% | -0.10% |

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。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2024年6月30日，本公司旗下共管理184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 | - | 14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与创新投资部基金经理。具有14年证券、基金行业从业经验。 |
| 金 璜 | 本基金的基金助理 | 2022年8月2日 | - | 8年 | 工学硕士，CFA。曾任美国AltfestPersonalWealthManagement（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员，Morgan Stanley（美国摩根士丹利）风险管理部信用风险分析员。2018年7月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF与创新投资部研究员、ETF与创新投资部基金经理助理，自2023年9月起担任ETF与创新投资部基金经理。具有8年证券、基金行业从业经验。 |
| 郑 天 行 | 本基金的基金助理 | 2023年9月13日 | - | 10年 | 理学硕士，CFA。曾任美国摩根斯坦利（纽约）对冲基金投资组合分析员，美国Aristeia基金（纽约）数据分析员，美国 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 城堡基金（纽约）大数据研究员。2019年5月加入本公司，历任养老及资产配置部研究员、ETF 投资部研究员、专户投资部投资经理，自2022年8月起担任ETF与创新投资部基金经理。具有10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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》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9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

上半年，A 股权益市场整体情绪分化较为明显，宽基指数涨跌幅及排序为：沪深 300(0.89%)> 上证指数(-0.25%)> 中小 100(-5.86%)> 创业板指(-10.99%)> 科创 50(-16.42%)。市值维度，总体表现出大盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：沪深 300(0.89%)> 中证 500(-8.96%)> 中证 1000(-16.84%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：稳定(8.79%)> 金融(2.77%)> 周期(-1.21%)> 消费(-13.24%)> 成长(-14.76%)。行业维度，涨跌幅排前五行业为：银行(17.02%)、煤炭(11.96%)、公用事业(11.76%)、家用电器(8.48%)、石油石化(7.90%)，排后五行业为：综合(-33.34%)、计算机(-24.88%)、商贸零售(-24.59%)、社会服务(-24.05%)、传媒(-21.33%)。

宏观数据层面，主要经济活动指标：6 月工业增加值同比增长 5.3%，前值 5.6%，经季节调整后环比增长 0.42%；6 月 PMI 49.5，5 月 49.5；6 月社会消费品零售总额同比增长 2.0%。通胀指标：6 月 PPI 同比-0.8%，前值-1.4%；6 月 CPI 同比 0.2%，前值 0.3%。货币金融指标：5 月 M2 同比增长 6.2%，前值 7.0%；6 月社会融资规模同比增长 8.1%，前值 8.4%。总体来看，增长斜率保持稳定，继续保持良好的复苏态势，同时通胀仍处在低位区间运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，本基金份额净值增长率为-11.76%，业绩比较基准收益率为-12.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益市场的长期趋势反映上市公司总体盈利能力的逐步提升，背后的驱动力是经济长期增长动能以及科技升级、产业升级带来的生产力提升。目前主要宽基指数估值水平处在历史低位，近期结束的三中全会给未来高质量发展定下了目标和实现途径，在经济复苏大背景下，权益市场配置价值凸显。

本基金采用复制标的指数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、标的指数成分调整情况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、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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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遵规守信、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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金本年度中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 3,727,783.21 | 4,725,831.41 |
| 结算备付金 | | 52,674.29 | 110,992.45 |
| 存出保证金 | | 19,008.61 | 62,059.06 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 294,233,129.76 | 407,752,100.11 |
| 其中：股票投资 | | 294,233,129.76 | 407,752,100.11 |
| 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 73,759.75 | 311,853.80 |
| 应收股利 | | 12,600.00 | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | 19,531.67 | 8,531.88 |
| 资产总计 | | 298,138,487.29 | 412,971,368.71 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 应付清算款 | | 95,510.50 | 284,246.37 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 129,442.91 | 171,658.97 |
| 应付托管费 | | 25,888.59 | 34,331.82 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,011.49 | 648.15 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 219,029.19 | 739,439.76 |
| 负债合计 | | 470,882.68 | 1,230,325.07 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 675,931,891.00 | 824,931,891.00 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -378,264,286.39 | -413,190,847.36 |
| 净资产合计 | | 297,667,604.61 | 411,741,043.64 |
| 负债和净资产总计 | | 298,138,487.29 | 412,971,368.71 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.4404 元，基金份额总额 675,931,891.00 份。

6.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -44,734,462.39 | -32,633,232.30 |
| 1. 利息收入 | | 264,180.60 | 706,332.08 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 8,737.25 | 14,657.09 |
| 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 | | 255,443.35 | 691,674.99 |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -57,146,190.59 | -34,719,715.97 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -61,678,104.29 | -37,562,226.83 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 4,531,913.70 | 2,842,510.86 |
| 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） | 6.4.7.20 | 12,150,849.61 | 1,310,687.47 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | -3,302.01 | 69,464.12 |
| 减：二、营业总支出 | | 1,193,261.73 | 1,614,146.15 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 848,582.58 | 1,200,478.99 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 169,716.55 | 240,095.85 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 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 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 919.64 | 2,490.11 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 174,042.96 | 171,081.20 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -45,927,724.12 | -34,247,378.45 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -45,927,724.12 | -34,247,378.45 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -45,927,724.12 | -34,247,378.45 |

6.3 净资产变动表

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：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30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 | 824,931,891.00 | - | -413,190,847.36 | 411,741,043.64 |

| | | | | |
|--|----------------------|--------|-----------------|-----------------|
| 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 | 824,931,891.00 | - | -413,190,847.36 | 411,741,043.64 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -149,000,000.00 | - | 34,926,560.97 | -114,073,439.03 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -45,927,724.12 | -45,927,724.12 |
| （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） | -149,000,000.00 | - | 80,854,285.09 | -68,145,714.91 |
| 其中：1. 基金申购款 | 220,000,000.00 | - | -118,461,479.03 | 101,538,520.97 |
| 2. 基金赎回款 | -369,000,000.00 | - | 199,315,764.12 | -169,684,235.88 |
| （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 | 675,931,891.00 | - | -378,264,286.39 | 297,667,604.61 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2023年1月1日至2023年6月30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 | 722,931,891.00 | - | -204,624,918.66 | 518,306,972.34 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|-----------------|---|-----------------|-----------------|
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 722,931,891.00 | - | -204,624,918.66 | 518,306,972.34 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 55,000,000.00 | - | -55,735,161.03 | -735,161.03 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -34,247,378.45 | -34,247,378.45 |
| （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） | 55,000,000.00 | - | -21,487,782.58 | 33,512,217.42 |
| 其中：1. 基金申购款 | 441,000,000.00 | - | -136,472,429.23 | 304,527,570.77 |
| 2. 基金赎回款 | -386,000,000.00 | - | 114,984,646.65 | -271,015,353.35 |
| （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 | 777,931,891.00 | - | -260,360,079.69 | 517,571,811.31 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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(包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。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立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发起式联接基金(以下简称“景顺长城国证新能源车电池 ETF 发起式联接基金”)。景顺长城国证新能源车电池 ETF 发起式联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2024 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则、《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》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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财税[2023]39 号《关于减半征收交易印花税的公告》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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前(如适用)运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起(如适用)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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款 | 3,727,783.21 |
| 等于：本金 | 3,727,442.83 |
| 加：应计利息 | 340.38 |
| 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个月（含）-3个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 3,727,783.21 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 | | | |
|-------------------|-------------------|------|----------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 388,885,023.31 | - | 294,233,129.76 | -94,651,893.55 |
| 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 | 388,885,023.31 | - | 294,233,129.76 | -94,651,893.55 |

注：于2024年6月30日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值0.00元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | 19,531.67 |

| | |
|------|-----------|
| 待摊费用 | - |
| 合计 | 19,531.67 |

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 28,253.29 |
| 其中：交易所市场 | 28,253.29 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 174,042.96 |
| 应退替代款 | 16,732.94 |
| 合计 | 219,029.19 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 824,931,891.00 | 824,931,891.00 |
| 本期申购 | 220,000,000.00 | 220,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -369,000,000.00 | -369,000,000.00 |
| 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 | 675,931,891.00 | 675,931,891.00 |

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | -123,739,616.98 | -289,451,230.38 | -413,190,847.36 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -123,739,616.98 | -289,451,230.38 | -413,190,847.36 |

| | | | |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 本期利润 | -58,078,573.73 | 12,150,849.61 | -45,927,724.12 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 29,329,678.53 | 51,524,606.56 | 80,854,285.09 |
| 其中：基金申购款 | -39,792,445.40 | -78,669,033.63 | -118,461,479.03 |
| 基金赎回款 | 69,122,123.93 | 130,193,640.19 | 199,315,764.12 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -152,488,512.18 | -225,775,774.21 | -378,264,286.39 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-----------|----------------------|----------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
| 活期存款利息收入 | | 7,125.64 |
| 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 | | 1,307.12 |
| 其他 | | 304.49 |
| 合计 | | 8,737.25 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------------|----------------------|----------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | | -19,655,071.69 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | | -42,023,032.60 |
| 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 | | -61,678,104.29 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------|----------------------|----------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
| 卖出股票成交总额 | | 67,179,265.68 |
| 减：卖出股票成本总额 | | 86,749,893.25 |
| 减：交易费用 | | 84,444.12 |
| 买卖股票差价收入 | | -19,655,071.69 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|------------|----------------------|----------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
| 赎回基金份额对价总额 | | 169,684,235.88 |

| | |
|-------------|----------------|
| 减：现金支付赎回款总额 | 15,485,906.88 |
| 减：赎回股票成本总额 | 196,221,361.60 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | -42,023,032.60 |

6.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 4,531,913.70 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | 280,104.78 |

| | |
|-------------|--------------|
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 4,531,913.70 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 12,150,849.61 |
| 股票投资 | 12,150,849.61 |
| 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 | 12,150,849.61 |

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0.00元。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | -3,302.01 |
| 合计 | -3,302.01 |

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申赎本基金时，补入（卖出）被替代成分券的实际买入（卖出）成本与申赎确认日估值的差额，或强制退款的被替代成分券在强制退款计算日与申赎确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用 | 29,835.26 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |

| | |
|----------|------------|
| 证券出借违约金 | - |
| IOPV 数据费 | 9,944.48 |
| 注册登记费 | 74,590.88 |
| 合计 | 174,042.96 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 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、基金销售机构 |
| 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发起式联接基金（“景顺长城国证新能源车电池 ETF 发起式联接基金”） | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 |
|----|--------------------------------|-----------------------------------|
|----|--------------------------------|-----------------------------------|

| | 月 30 日 | 6 月 30 日 |
|------------------|------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 848,582.58 | 1,200,478.99 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 162,393.42 | - |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 686,189.16 | 1,200,478.99 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 169,716.55 | 240,095.85 |

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 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|-------|------------------------|--------------------------|
|-------|------------------------|--------------------------|

| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%) |
|---------------------------------|---------------|------------------------------|---------------|------------------------------|
| 景顺长城国 证新能源车 电池ETF联接 基金 | 79,018,200.00 | 11.69 | 77,130,100.00 | 9.35 |

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30 日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|---------|--------------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 华夏银行-活期 | 3,727,783.21 | 7,125.64 | 5,792,068.64 | 11,072.84 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------------------|-----------------------|-------------|----------------------------|------------------|----------------------------|------------------------------|----------------------------|----------------------------|--------|
| 证券 代码 | 证 券 名 称 | 成 功 认 购 日 | 受 限 期 | 流 通 受 限 类 型 | 认 购 价 格 | 期 末 估 值 单 价 | 数 量 （ 单 位： 股） | 期 末 成 本 总 额 | 期 末 估 值 总 额 | 备 注 |
| 001359 | 平安 电 工 | 2024 年3月 19日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 17.39 | 20.60 | 184 | 3,199.76 | 3,790.40 | - |
| 001379 | 腾 达 科 技 | 2024 年1月 11日 | 6个月 | 新 股 流 通 受 限 | 16.98 | 13.48 | 213 | 3,616.74 | 2,871.24 | - |
| 001387 | 雪 祺 | 2024 年1月 | 6个月 | 新 股 流 通 | 15.38 | 15.25 | 133 | 2,045.54 | 2,028.25 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|----------|--------|-------|-------|-----|----------|-----------|-----|
| | 电气 | 4日 | | 受限 | | | | | | |
| 001387 | 雪祺电气 | 2024年6月3日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | - | 15.25 | 40 | - | 610.00 | 转增股 |
| 001389 | 广合科技 | 2024年3月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.43 | 34.56 | 222 | 3,869.46 | 7,672.32 | - |
| 301392 | 汇成真空 | 2024年5月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 12.20 | 41.66 | 219 | 2,671.80 | 9,123.54 | - |
| 301502 | 华阳智能 | 2024年1月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.01 | 37.83 | 138 | 3,865.38 | 5,220.54 | - |
| 301536 | 星宸科技 | 2024年3月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.16 | 32.27 | 481 | 7,772.96 | 15,521.87 | - |
| 301538 | 骏鼎达 | 2024年3月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.82 | 91.24 | 107 | 5,972.74 | 9,762.68 | - |
| 301538 | 骏鼎达 | 2024年5月22日 | 1-6个月(含) | 新股流通受限 | - | 91.24 | 43 | - | 3,923.32 | 转增股 |
| 301539 | 宏鑫科技 | 2024年4月3日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.64 | 19.82 | 361 | 3,841.04 | 7,155.02 | - |
| 301565 | 中仑新材 | 2024年6月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.88 | 18.98 | 711 | 8,446.68 | 13,494.78 | - |
| 301566 | 达利凯普 | 2023年12月22日 | 6个月以上 | 新股流通受限 | 8.90 | 16.97 | 576 | 5,126.40 | 9,774.72 | - |
| 301580 | 爱迪特 | 2024年6月19日 | 6个月 | 新股流通受限 | 44.95 | 65.93 | 202 | 9,079.90 | 13,317.86 | - |
| 301587 | 中 | 2024 | 6个月 | 新股 | 21.73 | 25.26 | 306 | 6,649.38 | 7,729.56 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------|-----|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| | 瑞股份 | 年3月27日 | | 流通受限 | | | | | | |
| 301588 | 美新科技 | 2024年3月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 14.50 | 21.25 | 257 | 3,726.50 | 5,461.25 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 出借到期日 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末估值总额 |
|----|--------|------|----------------------|--------|----------|---------------|
| 1 | 000009 | 中国宝安 | 2024年7月12日 | 8.60 | 39,500 | 339,700.00 |
| 2 | 002050 | 三花智控 | 2024年7月2日 | 19.08 | 21,400 | 408,312.00 |
| 3 | 002074 | 国轩高科 | 2024年7月1日-2024年7月4日 | 19.15 | 126,000 | 2,412,900.00 |
| 4 | 002407 | 多氟多 | 2024年7月1日-2024年7月8日 | 12.23 | 121,700 | 1,488,391.00 |
| 5 | 002460 | 赣锋锂业 | 2024年7月1日-2024年7月8日 | 28.65 | 127,400 | 3,650,010.00 |
| 6 | 002850 | 科达利 | 2024年7月8日-2024年7月10日 | 76.38 | 19,900 | 1,519,962.00 |
| 7 | 300073 | 当升科技 | 2024年7月1日-2024年7月2日 | 34.31 | 46,100 | 1,581,691.00 |
| 8 | 301358 | 湖南裕能 | 2024年7月1日-2024年7月2日 | 31.46 | 45,600 | 1,434,576.00 |
| 合计 | - | - | - | - | 547,600 | 12,835,542.00 |

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告‘本基金持有的流通受限证券’部分内容。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：同）。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（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的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上市公司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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024年6月30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 | 3,727,783.21 | - | - | - | - | - | 3,727,783.21 |
| 结算备付金 | 52,674.29 | - | - | - | - | - | 52,674.29 |
| 存出保证金 | 19,008.61 | - | - | - | - | - | 19,008.61 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -294,233,129.76 | 294,233,129.76 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 12,600.00 | 12,600.00 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 73,759.75 | 73,759.75 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 19,531.67 | 19,531.67 |
| 资产总计 | 3,799,466.11 | - | - | - | - | -294,339,021.18 | 298,138,487.29 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 129,442.91 | 129,442.91 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 25,888.59 | 25,888.59 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 95,510.50 | 95,510.50 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 1,011.49 | 1,011.49 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 219,029.19 | 219,029.19 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 470,882.68 | 470,882.68 |
| 利率敏感度缺口 | 3,799,466.11 | - | - | - | - | - | - |
| 上年度末 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 | 4,725,831.41 | - | - | - | - | - | 4,725,831.41 |
| 结算备付金 | 110,992.45 | - | - | - | - | - | 110,992.45 |
| 存出保证金 | 62,059.06 | - | - | - | - | - | 62,059.06 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -407,752,100.11 | 407,752,100.11 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 311,853.80 | 311,853.80 |

| | | | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---|---|----------------|----------------|
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 8,531.88 | 8,531.88 |
| 资产总计 | 4,898,882.92 | - | - | - | - | 408,072,485.79 | 412,971,368.71 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 171,658.97 | 171,658.97 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 34,331.82 | 34,331.82 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 284,246.37 | 284,246.37 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 648.15 | 648.15 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 739,439.76 | 739,439.76 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,230,325.07 | 1,230,325.07 |
| 利率敏感度缺口 | 4,898,882.92 | - | - | - | - | - | - |

6.4.13.4.1.2 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（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 | | 上年度末 2023年12月31日 | |
|---------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值 比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 294,233,129.76 | 98.85 | 407,752,100.11 | 99.03 |
| 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 | 294,233,129.76 | 98.85 | 407,752,100.11 | 99.03 |
|----|----------------|-------|----------------|-------|

6.4.13.4.3.2 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（2024 年 6 月 30 日） | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 25,428,151.83 | 35,573,306.93 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -25,428,151.83 | -35,573,306.93 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 294,115,672.41 | 406,813,467.62 |
| 第二层次 | 9,774.72 | 20,572.44 |
| 第三层次 | 107,682.63 | 918,060.05 |
| 合计 | 294,233,129.76 | 407,752,100.11 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属

第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 294,233,129.76 | 98.69 |
| | 其中：股票 | 294,233,129.76 | 98.69 |
| 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 | 3,780,457.50 | 1.27 |
| 8 | 其他各项资产 | 124,900.03 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 298,138,487.29 | 100.00 |

注：权益投资中参与转融通证券出借业务出借证券公允价值为 12,835,542.00 元，占基金资产净值的比例为 4.31%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 | - | - |
| C | 制造业 | 288,350,447.41 | 96.87 |
| 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 | 5,765,225.00 | 1.94 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 294,115,672.41 | 98.81 |

7.2.2 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 | 117,457.35 | 0.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|------------|------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 117,457.35 | 0.04 |

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 002594 | 比亚迪 | 200,573 | 50,193,393.25 | 16.86 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 244,579 | 44,031,557.37 | 14.79 |
| 3 | 300014 | 亿纬锂能 | 532,104 | 21,241,591.68 | 7.14 |
| 4 | 002050 | 三花智控 | 871,324 | 16,624,861.92 | 5.59 |
| 5 | 002460 | 赣锋锂业 | 465,343 | 13,332,076.95 | 4.48 |
| 6 | 002340 | 格林美 | 2,038,643 | 12,986,155.91 | 4.36 |
| 7 | 603799 | 华友钴业 | 576,500 | 12,757,945.00 | 4.29 |
| 8 | 002709 | 天赐材料 | 505,002 | 8,867,835.12 | 2.98 |
| 9 | 300207 | 欣旺达 | 581,792 | 8,825,784.64 | 2.96 |
| 10 | 002074 | 国轩高科 | 458,798 | 8,785,981.70 | 2.95 |
| 11 | 300450 | 先导智能 | 413,068 | 6,869,320.84 | 2.31 |
| 12 | 002812 | 恩捷股份 | 208,186 | 6,589,086.90 | 2.21 |
| 13 | 600549 | 厦门钨业 | 368,900 | 6,363,525.00 | 2.14 |
| 14 | 603659 | 璞泰来 | 437,594 | 6,183,203.22 | 2.08 |
| 15 | 300073 | 当升科技 | 170,000 | 5,832,700.00 | 1.96 |
| 16 | 300037 | 新宙邦 | 203,311 | 5,806,562.16 | 1.95 |
| 17 | 000009 | 中国宝安 | 670,375 | 5,765,225.00 | 1.94 |
| 18 | 002850 | 科达利 | 72,759 | 5,557,332.42 | 1.87 |
| 19 | 300919 | 中伟股份 | 176,252 | 5,462,049.48 | 1.83 |
| 20 | 002407 | 多氟多 | 443,200 | 5,420,336.00 | 1.82 |
| 21 | 301358 | 湖南裕能 | 168,000 | 5,285,280.00 | 1.78 |
| 22 | 300390 | 天华新能 | 248,664 | 4,272,047.52 | 1.44 |
| 23 | 002056 | 横店东磁 | 339,100 | 4,228,577.00 | 1.42 |
| 24 | 300568 | 星源材质 | 512,462 | 4,202,188.40 | 1.41 |
| 25 | 600884 | 杉杉股份 | 485,393 | 3,941,391.16 | 1.32 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 26 | 002080 | 中材科技 | 292,300 | 3,770,670.00 | 1.27 |
| 27 | 688005 | 容百科技 | 134,278 | 3,125,991.84 | 1.05 |
| 28 | 688567 | 孚能科技 | 296,828 | 2,849,548.80 | 0.96 |
| 29 | 688063 | 派能科技 | 68,799 | 2,732,008.29 | 0.92 |
| 30 | 835185 | 贝特瑞 | 120,318 | 2,211,444.84 | 0.74 |

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1 | 301536 | 星辰科技 | 481 | 15,521.87 | 0.01 |
| 2 | 301538 | 骏鼎达 | 150 | 13,686.00 | 0.00 |
| 3 | 301565 | 中仑新材 | 711 | 13,494.78 | 0.00 |
| 4 | 301580 | 爱迪特 | 202 | 13,317.86 | 0.00 |
| 5 | 301566 | 达利凯普 | 576 | 9,774.72 | 0.00 |
| 6 | 301392 | 汇成真空 | 219 | 9,123.54 | 0.00 |
| 7 | 301587 | 中瑞股份 | 306 | 7,729.56 | 0.00 |
| 8 | 001389 | 广合科技 | 222 | 7,672.32 | 0.00 |
| 9 | 301539 | 宏鑫科技 | 361 | 7,155.02 | 0.00 |
| 10 | 301588 | 美新科技 | 257 | 5,461.25 | 0.00 |
| 11 | 301502 | 华阳智能 | 138 | 5,220.54 | 0.00 |
| 12 | 001359 | 平安电工 | 184 | 3,790.40 | 0.00 |
| 13 | 001379 | 腾达科技 | 213 | 2,871.24 | 0.00 |
| 14 | 001387 | 雪祺电气 | 173 | 2,638.25 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 603799 | 华友钴业 | 7,477,882.61 | 1.82 |
| 2 | 002460 | 赣锋锂业 | 5,855,602.20 | 1.42 |
| 3 | 301358 | 湖南裕能 | 5,137,353.00 | 1.25 |
| 4 | 603659 | 璞泰来 | 3,765,799.10 | 0.91 |
| 5 | 002594 | 比亚迪 | 2,978,156.00 | 0.72 |
| 6 | 300750 | 宁德时代 | 2,846,069.60 | 0.69 |
| 7 | 600549 | 厦门钨业 | 2,780,190.00 | 0.68 |
| 8 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,612,229.00 | 0.63 |
| 9 | 002850 | 科达利 | 2,547,901.00 | 0.62 |
| 10 | 002050 | 三花智控 | 2,540,978.00 | 0.62 |
| 11 | 002709 | 天赐材料 | 2,407,355.00 | 0.58 |
| 12 | 600884 | 杉杉股份 | 2,407,203.00 | 0.58 |
| 13 | 688005 | 容百科技 | 2,387,881.68 | 0.58 |
| 14 | 835185 | 贝特瑞 | 2,382,589.76 | 0.58 |
| 15 | 002340 | 格林美 | 2,160,867.00 | 0.52 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 16 | 002074 | 国轩高科 | 1,736,218.00 | 0.42 |
| 17 | 688567 | 孚能科技 | 1,644,717.77 | 0.40 |
| 18 | 002407 | 多氟多 | 1,631,608.00 | 0.40 |
| 19 | 300073 | 当升科技 | 1,148,471.00 | 0.28 |
| 20 | 300207 | 欣旺达 | 1,071,349.00 | 0.26 |

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 002594 | 比亚迪 | 13,966,161.00 | 3.39 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 12,355,828.00 | 3.00 |
| 3 | 603799 | 华友钴业 | 8,077,323.90 | 1.96 |
| 4 | 002460 | 赣锋锂业 | 4,379,335.00 | 1.06 |
| 5 | 603659 | 璞泰来 | 3,734,324.00 | 0.91 |
| 6 | 600549 | 厦门钨业 | 3,410,536.93 | 0.83 |
| 7 | 600884 | 杉杉股份 | 3,076,299.00 | 0.75 |
| 8 | 300769 | 德方纳米 | 2,947,659.82 | 0.72 |
| 9 | 688005 | 容百科技 | 2,452,826.10 | 0.60 |
| 10 | 688567 | 孚能科技 | 2,084,013.77 | 0.51 |
| 11 | 002709 | 天赐材料 | 1,524,691.00 | 0.37 |
| 12 | 688063 | 派能科技 | 1,209,950.18 | 0.29 |
| 13 | 300073 | 当升科技 | 681,378.00 | 0.17 |
| 14 | 300014 | 亿纬锂能 | 538,608.00 | 0.13 |
| 15 | 002074 | 国轩高科 | 507,064.00 | 0.12 |
| 16 | 002050 | 三花智控 | 504,594.00 | 0.12 |
| 17 | 002340 | 格林美 | 482,254.00 | 0.12 |
| 18 | 002407 | 多氟多 | 437,165.80 | 0.11 |
| 19 | 002812 | 恩捷股份 | 428,767.00 | 0.10 |
| 20 | 301358 | 湖南裕能 | 385,856.00 | 0.09 |

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。

7.4.3 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 | 66,955,590.20 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 67,179,265.68 |

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。

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 19,008.61 |
| 2 | 应收清算款 | 73,759.75 |
| 3 | 应收股利 | 12,600.00 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 19,531.67 |

| | | |
|---|------|------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 124,900.03 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1 | 002460 | 赣锋锂业 | 3,650,010.00 | 1.23 | 转融通流通受限 |
| 2 | 002074 | 国轩高科 | 2,412,900.00 | 0.81 | 转融通流通受限 |
| 3 | 002050 | 三花智控 | 408,312.00 | 0.14 | 转融通流通受限 |

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1 | 301536 | 星宸科技 | 15,521.87 | 0.01 | 新股流通受限 |
| 2 | 301538 | 骏鼎达 | 13,686.00 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 3 | 301565 | 中仑新材 | 13,494.78 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 4 | 301580 | 爱迪特 | 13,317.86 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 5 | 301566 | 达利凯普 | 9,774.72 | 0.00 | 新股流通受限 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | 华夏银行股份有限公司-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发起式联接基金 |
|-----------|-----------|-------|-------|--|
| | | 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 (%) | 持有份额 | 占总 份额 比例 (%) |
|--------|-----------|---------------|-----------------------|----------------|-----------------------|---------------|-----------------------|
| 10,073 | 67,103.33 | 32,524,918.00 | 4.81 | 564,388,773.00 | 83.50 | 79,018,200.00 | 11.69 |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例（%） |
|----|--|---------------|-------------|
| 1 | 华夏银行股份有限公司—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发起式联接基金 | 79,018,200.00 | 11.69 |
| 2 | 平安资产—工商银行—平安资产如意 11 号保险资产管理产品 | 8,724,800 | 1.29 |
| 3 | 中信建投证券股份有限公司 | 8,048,657 | 1.19 |
| 4 | 招商证券股份有限公司 | 6,099,343 | 0.90 |
| 5 | 陈晶 | 5,549,700 | 0.82 |
| 6 | 赵霆 | 5,080,800 | 0.75 |
| 7 | 张庆先 | 5,000,000 | 0.74 |
| 8 | 周建裕 | 4,921,000 | 0.73 |
| 9 | 史德洪 | 4,400,000 | 0.65 |
| 10 | 李瑞敏 | 3,972,700 | 0.59 |
| 11 | 史国利 | 3,967,668 | 0.59 |

8.3 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。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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 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 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 824,931,891.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 220,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 369,000,000.00 |

| | |
|--------------|----------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 675,931,891.00 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 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，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------------|--------|----------------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 招商证券股份有限公司 | 4 | 131,096,727.70 | 98.21 | 40,030.86 | 95.03 | - |

| | | | | | | |
|--------------------|---|--------------|------|----------|------|---|
| 中信证券 股份有限 公司 | 1 | 2,391,435.09 | 1.79 | 2,092.50 | 4.97 | - |
|--------------------|---|--------------|------|----------|------|---|

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、本基金本期交易单元未变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 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 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|----------------------------------|--------------|-----------|
| 1 | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下证券投资基金指定证券投资基金主流 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年1月4日 |

| | | | |
|----|---|--------------|------------|
| | 动性服务商的公告 | | |
| 2 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年1月10日 |
| 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 2023 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年1月22日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年1月22日 |
| 5 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年3月20日 |
| 6 | 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 | 2024年3月22日 |
| 7 | 关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年3月27日 |
| 8 | 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 2023 年年度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年3月29日 |
| 9 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年3月29日 |
| 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 | 2024年4月13日 |
| 11 | 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 | 2024年4月15日 |
| 12 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东兴证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年4月18日 |
| 13 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年4月22日 |
| 14 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东吴证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年4月22日 |
| 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 2024 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年4月22日 |
| 16 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤海证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年5月20日 |
| 17 | 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 | 2024年5月24日 |
| 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 | 2024年5月31日 |
| 19 | 景顺长城国证新能源车电池交易型开 | 中国证监会指定报刊及 | 2024年6月14日 |

| | | | |
|----|---------------------------------------|--------------|------------|
| | 放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 网站 | |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年6月18日 |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联储证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年6月20日 |
| 22 | 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 | 2024年6月21日 |
| 23 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券为一级交易商的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2024年6月21日 |
| 24 | 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 | 2024年6月29日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 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

2024 年 8 月 30 日