

# 东方新能源汽车主题混合型证券投资基金

## 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东方新能源汽车主题混合
基金主代码	400015
前端交易代码	400015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 21 日
报告期末基金份额总额	5,158,214,701.15 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金结合自上而下和自下而上的分析，在大类资产配置基础上精选个股，严格控制投资风险，追求基金的长期、稳定增值。
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×80%+银行活期存款利率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。
基金管理人	东方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-227,820,242.41
2. 本期利润	-5,005,158,852.85

3. 加权平均基金份额本期利润	-0.9828
4. 期末基金资产净值	16,270,963,611.69
5. 期末基金份额净值	3.1544

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

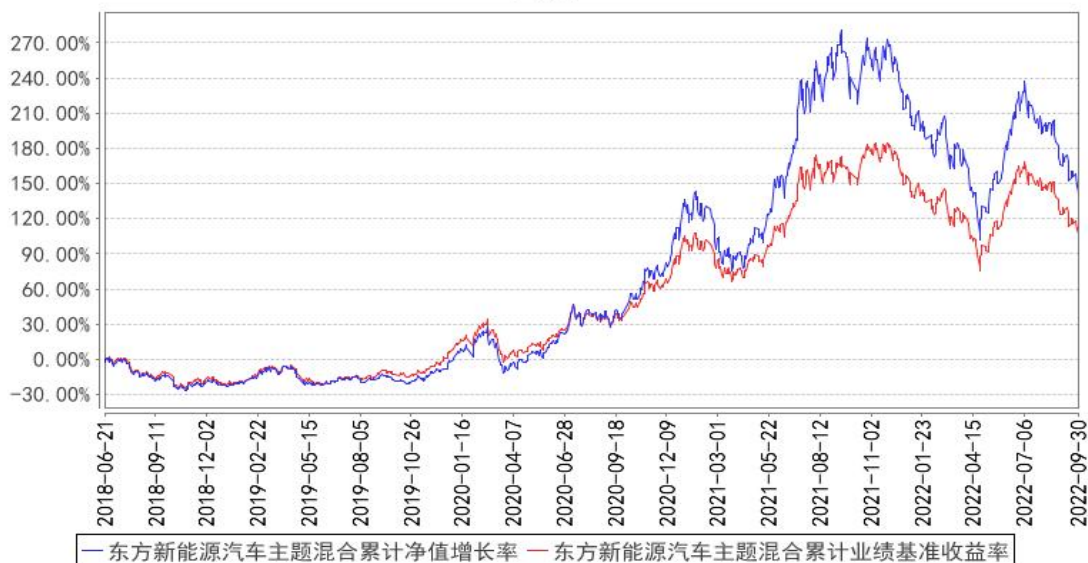
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-23.86%	1.98%	-19.96%	1.60%	-3.90%	0.38%
过去六个月	-10.52%	2.38%	-6.30%	1.94%	-4.22%	0.44%
过去一年	-29.26%	2.31%	-20.14%	1.87%	-9.12%	0.44%
过去三年	194.17%	2.42%	137.02%	1.93%	57.15%	0.49%
自基金合同 生效起至今	140.90%	2.17%	106.59%	1.79%	34.31%	0.38%

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

东方新能源汽车主题混合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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李瑞	本基金基金经理、权益投资部总经理、公募投资决策委员会委员	2018年6月21日	-	11年	权益投资部总经理、公募投资决策委员会委员。中国人民大学金融学硕士，11年证券从业经历。2011年7月加盟本基金管理人，曾任绝对收益部副总经理、权益投资部研究员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金（于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（于2018年6月21日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金）基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理、东方汽车产业趋势混合型证券投资基金基金经理。

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011年修订），制定了公司公平交易管理制度。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金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 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

市场近期波动较大，宏观层面压力来自海外衰退概率上升及国内地产压力持续，消费始终难有大的起色，加上地缘政治影响，今年的复杂性比较少见。政策层面，8月下旬以来，国内政策持续聚焦“稳增长”领域，关注基建投资落地、地产纾困保交楼、村镇银行风险化解，尤其近期稳经济、托地产政策力度有所加强。

在汇率、经济下行压力、地缘政治等诸多因素的影响下，市场经历一波回调，权益资产逐步开始具备配置价值。后续市场将在价值和成长风格的平衡中寻找成长性景气的稀缺和确定性价值的回归。

就东方新能源汽车这个产品来说，今年我们一直强调的除了上游资源这样少数环节供需错配的机会外，还特别看重新技术方向。就产业自身演变看，技术变革带来的细分渗透率提升，4680、麒麟电池（CTP）、钠电池、新型正极磷酸锰铁锂、一体压铸、碳纳米管、中镍高电压、新型锂盐、复合集流体等，这些环节从 0 到 1 的变化，推动产业技术进步的同时也带来了相关上市公司盈利和估值的双击。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日，本基金净值增长率为-23.86%，业绩比较基准收益率为-19.96%，低于业绩比较基准 3.90%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	15,334,220,524.18	92.73
	其中：股票	15,334,220,524.18	92.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	930,105,946.16	5.62
	其中：债券	930,105,946.16	5.62
	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	188,337,785.72	1.14
8	其他资产	84,145,340.35	0.51
9	合计	16,536,809,596.41	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	720,910,709.96	4.43
C	制造业	14,341,591,031.65	88.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	113,779,992.55	0.70
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	157,938,790.02	0.97
	合计	15,334,220,524.18	94.24

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	5,222,021	1,316,001,512.21	8.09
2	300750	宁德时代	3,169,136	1,270,474,931.04	7.81
3	002466	天齐锂业	11,012,479	1,105,652,891.60	6.80
4	300014	亿纬锂能	10,999,864	930,588,494.40	5.72
5	002812	恩捷股份	5,060,778	881,182,665.36	5.42

6	002709	天赐材料	19,338,843	852,069,422.58	5.24
7	603799	华友钴业	11,889,055	764,941,798.70	4.70
8	300438	鹏辉能源	8,035,434	603,621,802.08	3.71
9	002192	融捷股份	5,181,723	583,254,740.88	3.58
10	002460	赣锋锂业	7,461,893	558,448,072.12	3.43

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	529,306,494.11	3.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	400,799,452.05	2.46
	其中：政策性金融债	400,799,452.05	2.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	930,105,946.16	5.72

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	5,208,600	529,306,494.11	3.25
2	220211	22 国开 11	4,000,000	400,799,452.05	2.46
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明



本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金所持有的亿纬锂能（300014）收到中国证券监督管理委员会广东监管局出具警示函的行政监管措施。

惠州亿纬锂能股份有限公司高级管理人员李沐芬女士的配偶赵前进先生分别于 2021 年 11 月 19 日及 2021 年 12 月 16 日买卖公司股票，根据《公司法》《证券法》《深圳证券交易所创业板上市公司规范运作指引》等相关法律法规的规定，上述交易构成短线交易。本次短线交易行为未发生在本公司披露定期报告的敏感期内，不存在因获悉内幕信息而交易公司股票的情况，亦不存在利用短线交易谋求利益的目的。

该公司知悉此事项后高度重视，及时核查相关情况，李沐芬女士及配偶赵前进先生亦积极配合、主动纠正，已将本次短线交易所得收益上交公司。公司将进一步要求全体董事、监事、高级管理人员加强相关法律、法规及规范性文件的学习，严格遵守有关规定，杜绝此类事件再次发生。

本基金所持有的恩捷股份(002812)董事马伟华先生的配偶于 2022 年 8 月 29 日通过集中竞价方式合计买入恩捷股份股票 400 股，成交均价为 194.10 元/股，成交金额为 77,640.00 元。

公司 2022 年半年度报告的披露日为 2022 年 8 月 31 日，上述买入公司股票行为违反了《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 1 号——主板上市公司规范运作》《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 10 号——股份变动管理》《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》等相关规则中关于上市公司董事、监事和高级管理人员及其亲属不得在上市公司定期报告披露前 30 日内买卖本公司股票及其衍生品种的相关规定。

公司知悉此事后高度重视，及时核查相关情况，马伟华先生及其配偶亦积极配合、主动纠正。公司对本次事项的处理措施如下：

1、经核查，马伟华先生事先并不知悉本次股票交易的相关情况，且并未告知其配偶有关公司经营的相关情况或其他未披露信息，本次股票交易系其配偶基债券代码：128095 债券简称：恩捷转债，于自身对二级市场情况判断作出的自主投资行为，不存在因提前获悉内幕信息而交易公司股票的情形。

2、马伟华先生已对上述违规情况进行了深刻反省，对于未能及时尽到督促义务深表自责，其配偶也已深刻认识到了本次违规事项的严重性，并保证今后不再发生此类事件。马伟华先生及其

配偶就本次窗口期违规买入公司股票的行为向公司及广大投资者致以诚挚的歉意。

3、马伟华先生及其配偶承诺未来 6 个月内不减持其所持有的公司股票，对于本次违规买入的公司 400 股股票承诺未来如出售该部分股票，所得全部收益归公司所有。

4、公司将以此为戒，并要求公司所有持股 5%以上股份的股东、董事、监事、高级管理人员再次认真学习《中华人民共和国证券法》《深圳证券交易所股票上市规则》《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 10 号——股份变动管理》等相关法律、法规和规范性文件，督促相关人员自身及其亲属严格遵守有关规定，杜绝此类情况的再次发生。

本基金所持有的鹏辉能源(300438)于 2021 年 11 月 25 日披露《关于董事配偶短线交易及致歉的公告》，陈骞配偶的证券账户于 2021 年 11 月 22 日、11 月 23 日累计买入鹏辉能源股票 73,900 股，成交金额 390.28 万元，并于 11 月 23 日、11 月 24 日卖出上述股份，成交金额 397.73 万元，上述行为构成短线交易。

陈骞作为鹏辉能源时任独立董事，未能督促配偶合规买卖股票，违反了《创业板股票上市规则（2020 年 12 月修订）》第 1.4 条、第 2.3.1 条以及《创业板上市公司规范运作指引（2020 年修订）》第 3.8.1 条的相关规定。

鉴于上述违规事实及情节，依据《创业板股票上市规则（2020 年 12 月修订）》第 12.6 条和《上市公司自律监管指引第 12 号——纪律处分实施标准》第三十八条的规定，经深交所纪律处分委员会审议通过，作出如下处分决定：对陈骞给予通报批评的处分。

本基金所持有的赣锋锂业（002460）于 2022 年 7 月 1 日收到中国证券监督管理委员会《立案告知书》（编号：证监立案字 0252022001 号），因涉嫌 A 股某上市公司股票二级市场内幕交易，根据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会于 2022 年 1 月 24 日决定对公司立案。

上述事项不会对该公司的正常生产经营活动产生影响。公司将持续关注上述事项的进展情况，积极配合中国证监会的相关工作，严格按照监管要求履行信息披露义务。

本基金决策依据及投资程序：

（1）研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

（2）投资决策委员会定期召开会议，讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

（3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基

金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资亿纬锂能主要基于以下原因：公司以锂原电池起跑并成为全球第一大锂原电池企业，并围绕着锂电领域逐步进行市场延伸，在包括动力储能、圆柱、小型消费等多个锂电市场成长为新的市场龙头，成为平台化锂电龙头企业。

本基金投资恩捷股份主要基于以下原因：作为目前行业内生产规模最大的锂电池隔膜供应商，公司持续扩张国内外产能布局，随着新增产能不断释放有望持续提升全球市场份额。

本基金投资鹏辉能源主要基于以下原因：公司深耕锂电行业多年，产品结构丰富，全面覆盖动力、消费、储能领域。(1) 储能电池领域，提前布局扩张产能，集中精力开拓国内外储能市场。(2) 动力电池领域，打造高性价比产品，优化客户结构。(3) 消费电池领域，积累了深厚的技术经验，合作多个知名企业。

本基金投资赣锋锂业主要基于以下原因：公司是兼具业绩弹性与成长性的锂业巨头。行业供需持续紧张，维持高景气，公司产能放量将带来自给率持续提升。

除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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、处罚的情况。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,224,130.91
2	应收证券清算款	45,143,836.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	35,777,373.31
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	84,145,340.35

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	5,197,287,367.44
报告期期间基金总申购份额	1,619,845,974.02
减：报告期期间基金总赎回份额	1,658,918,640.31
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	5,158,214,701.15

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,180,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,180,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.02

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

一、《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》

二、《东方新能源汽车主题混合型证券投资基金托管协议》

三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

## 9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

## 9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）查阅。

东方基金管理股份有限公司

2022 年 10 月 26 日