

融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金

2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 17 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                            |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 融通新能源汽车主题精选灵活配置混合                                                                                                          |
| 基金主代码      | 005668                                                                                                                     |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                     |
| 基金合同生效日    | 2018 年 6 月 15 日                                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 293,696,565.64 份                                                                                                           |
| 投资目标       | 本基金主要通过精选投资与新能源汽车主题相关的优质证券，在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。                                                        |
| 投资策略       | 本基金通过对股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产分布的实时监控，根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估进行灵活调整。在各类资产中，根据其参与市场基本要素的变动，调整各类资产在基金投资组合中的比例。 |
| 业绩比较基准     | 本基金的业绩比较基准为：中证新能源汽车指数收益率×70% + 中证香港 100 指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×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，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。                        |
| 基金管理人      | 融通基金管理有限公司                                                                                                                 |
| 基金托管人      | 中国建设银行股份有限公司                                                                                                               |

## § 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（2020 年 1 月 1 日-2020 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 8,680,904.68                        |
| 2. 本期利润         | -46,920,430.29                      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.2026                             |
| 4. 期末基金资产净值     | 350,753,691.62                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1943                              |

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

2、本报告所列示的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。

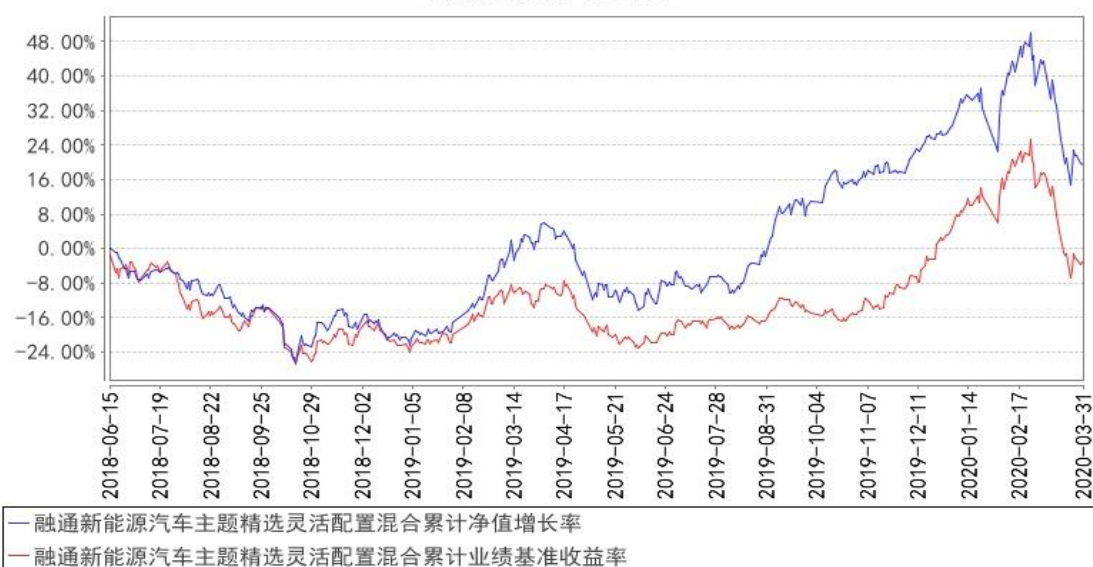
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -6.06%     | 2.57%         | -5.81%         | 2.36%                 | -0.25% | 0.21% |

#### 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

融通新能源汽车主题精选灵活配置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     |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 付伟琦 | 本基金的基金经理、研究部总经理 | 2018/6/15   | 2020/1/9 | 10     | 付伟琦先生，清华大学物理学博士，10 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2010 年 7 月至 2011 年 4 月就职于中信证券股份有限公司任研究员，2011 年 5 月至 2014 年 11 年就职于瑞银证券有限责任公司任研究员。2014 年 11 月加入融通基金管理有限公司，历任行业研究员、研究部总监助理、研究部总经理、融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通内需驱动混合型证券投资基金基金经理、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通蓝筹成长证券投资基金基金经理。 |
| 王迪  | 本基金的基金经理        | 2018-06-20  | -        | 9      | 王迪先生，计量金融学硕士，9 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2011 年 4 月至 2014 年 10 月就职于信达澳银基金管理有限公司任行业研究员。2014 年 11 月加入融通基金管理有限公司，历任行业研究员、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。                                                                                                                                           |

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券、基金业务相关工作的时间为计算标准。

#### 4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，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，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在

授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1-2 月基金加大了对新能源汽车和相关的汽车零部件配置, 我们认为今年新能源汽车的三条主线有望助推新能源汽车板块上行, 三条主线中第一是国内补贴退坡政策有望好于预期, 第二是因为碳排放考核压力导致欧洲新能源汽车销量大幅增长, 第三是龙头公司有望给整个汽车行业带来重大革新。实际情况是 1-2 月欧洲主要国家新能源汽车销量出现快速增长。

但 3 月开始疫情在海外蔓延速度超出预期, 造成欧洲主要车企停工, 市场预期欧洲的快速增长将出现停滞, 全球对可选消费品的消费能力将明显下降, 给新能源汽车板块带来较大冲击。鉴于疫情的严重程度的确影响到了新能源汽车的短期景气度, 3 月开始大幅加大了对重卡产业链的配置。主要原因为首先重卡主要以内需为主, 国内疫情形势已经基本明朗。其次预期国家将加大对基建等刺激力度以托底经济, 重卡产业链将有望明显受益。

待海外疫情拐点后, 随着海外汽车主机厂逐渐复工, 生活生产逐渐恢复正常, 我们仍然坚定看好新能源汽车的长期发展。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1943 元; 本报告期基金份额净值增长率为-6.06%, 业绩比较基准收益率为-5.81%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内, 本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### § 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   | 314,104,377.09 | 86.74        |
|    | 其中: 股票 | 314,104,377.09 | 86.74        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 108,155.20     | 0.03         |
|    | 其中: 债券 | 108,155.20     | 0.03         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 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      | 44,074,251.90  | 12.17  |
| 8 | 其他资产              | 3,829,784.13   | 1.06   |
| 9 | 合计                | 362,116,568.32 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 312,626,012.48 | 89.13        |
| 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           | 19,147.31      | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 273,374.85     | 0.08         |
| J  | 金融业              | 1,168,289.47   | 0.33         |
| 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       | 17,552.98      | 0.01         |
| 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               | 314,104,377.09 | 89.55        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 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  | 000338 | 潍柴动力 | 2,700,200 | 32,294,392.00 | 9.21         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 2  | 000951 | 中国重汽 | 1,400,204 | 28,326,126.92 | 8.08 |
| 3  | 000581 | 威孚高科 | 1,472,018 | 27,968,342.00 | 7.97 |
| 4  | 601799 | 星宇股份 | 236,000   | 19,767,360.00 | 5.64 |
| 5  | 002126 | 银轮股份 | 2,216,700 | 18,132,606.00 | 5.17 |
| 6  | 300750 | 宁德时代 | 148,400   | 17,865,876.00 | 5.09 |
| 7  | 300450 | 先导智能 | 431,200   | 16,152,752.00 | 4.61 |
| 8  | 601238 | 广汽集团 | 1,469,713 | 15,505,472.15 | 4.42 |
| 9  | 002179 | 中航光电 | 344,500   | 11,781,900.00 | 3.36 |
| 10 | 300124 | 汇川技术 | 444,560   | 11,491,876.00 | 3.28 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -          | -            |
| 2  | 央行票据      | -          | -            |
| 3  | 金融债券      | -          | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -            |
| 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） | 108,155.20 | 0.03         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 108,155.20 | 0.03         |

#### 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  | 128095 | 恩捷转债 | 920   | 108,155.20 | 0.03         |

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 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

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

### 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报告期内没有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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本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   | 264,988.03   |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 10,274.26    |
| 5  | 应收申购款   | 3,554,521.84 |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 3,829,784.13 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                |                |
|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 184,424,707.30 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 249,857,211.24 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 140,585,352.90 |
| 报告期期末基金份额总额    | 293,696,565.64 |

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

### § 8 备查文件目录

#### 8.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- （二）《融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- （四）《融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- （五）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- （六）报告期内在指定报刊上披露的各项公告

#### 8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

#### 8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站

<http://www.rtfund.com> 查询。

融通基金管理有限公司

2020 年 4 月 22 日

