

工银瑞信新能源汽车主题混合型证券投资  
基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 工银新能源汽车混合   |
| 基金主代码      | 005939  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2018 年 11 月 14 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 2,339,015,148.33 份  |
| 投资目标       | 本基金主要投资受益于新能源汽车主题的上市公司股票，采用积极主动的投资策略，在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产长期稳定增值，力争实现超越业绩基准的超额收益。  |
| 投资策略       | 本基金将在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。<br>在股票投资方面，在新能源汽车主题界定与行业选择基础上，本基金将通过定性分析和定量分析相结合的办法， |

|                 |   |                    |
|-----------------|---|--------------------|
|                 | 自上而下考察市场估值以及行业基本面，自下而上通过对细分行业的变化、价格及技术的最新进展、个股的竞争力等方面的考察决定组合配置。重点关注能够坚持研发并运用新能源汽车先进技术的上市公司，通过进一步对估值水平的评估，最终选择优质且估值合理的上市公司的股票进行投资。 |                    |
| 业绩比较基准          | 80%×中证新能源汽车指数收益率+20%×中债综合财富（总值）指数收益率。   |                    |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金、高于债券型基金与货币市场基金。  |                    |
| 基金管理人           | 工银瑞信基金管理有限公司  |                    |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司  |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 工银新能源汽车混合 A   | 工银新能源汽车混合 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 005939  | 005940             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,200,227,432.57 份  | 1,138,787,715.76 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2021年7月1日-2021年9月30日） |                  |
|-----------------|---------------------------|------------------|
|                 | 工银新能源汽车混合 A               | 工银新能源汽车混合 C      |
| 1. 本期已实现收益      | 927,711,464.43            | 853,641,347.68   |
| 2. 本期利润         | 702,237,285.14            | 691,542,153.23   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.6693                    | 0.7027           |
| 4. 期末基金资产净值     | 5,083,009,316.83          | 4,724,699,352.87 |
| 5. 期末基金份额净值     | 4.2350                    | 4.1489           |

注：1、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。

2、本期已实现收益是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。

3、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 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

工银新能源汽车混合 A

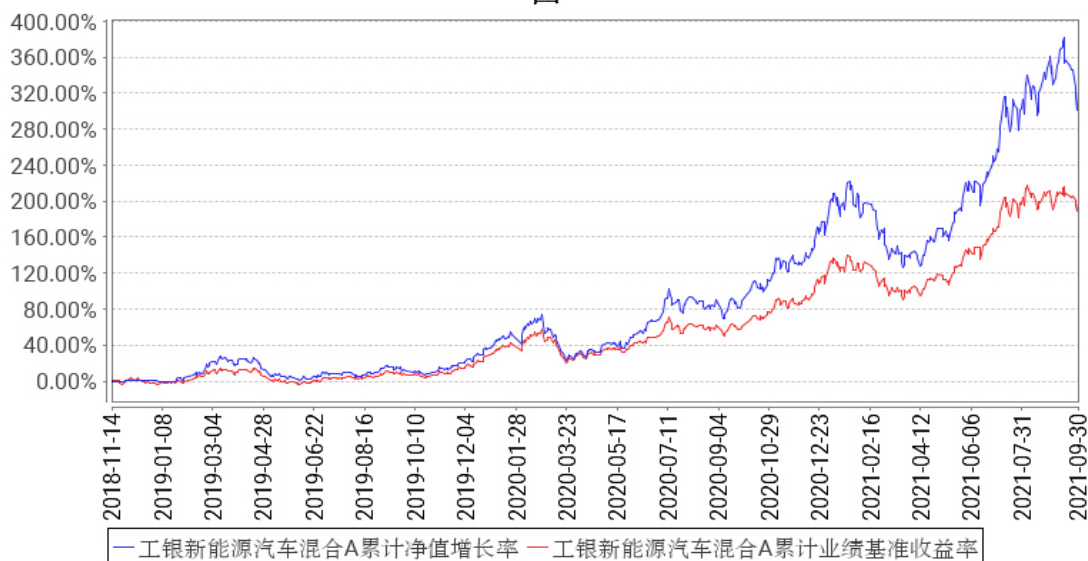
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 21.10%  | 3.22%     | 11.18%     | 2.35%         | 9.92%   | 0.87% |
| 过去六个月      | 78.59%  | 2.85%     | 51.03%     | 2.10%         | 27.56%  | 0.75% |
| 过去一年       | 124.62% | 2.83%     | 86.34%     | 2.06%         | 38.28%  | 0.77% |
| 自基金合同生效起至今 | 323.50% | 2.23%     | 199.56%    | 1.66%         | 123.94% | 0.57% |

工银新能源汽车混合 C

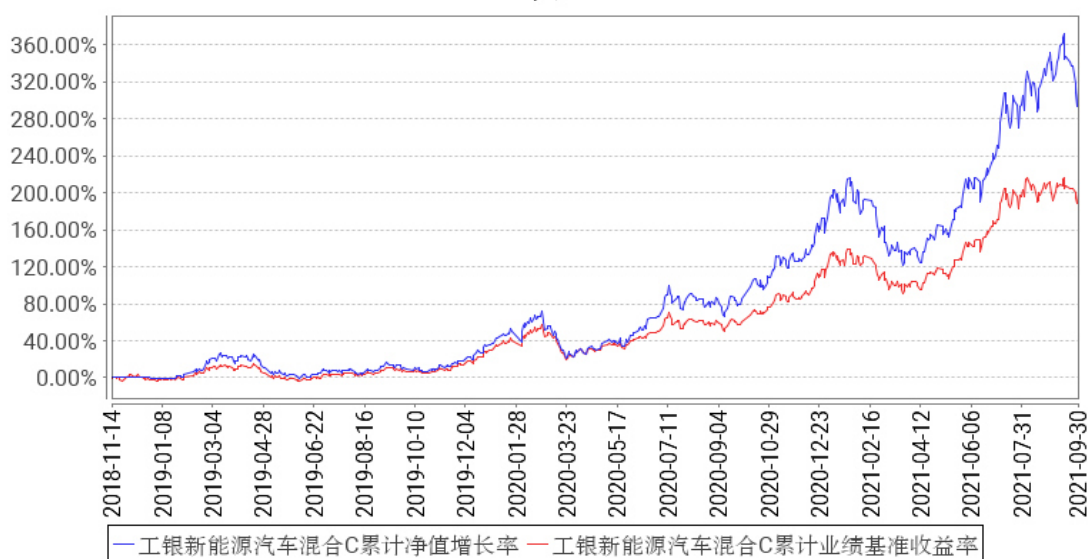
| 阶段         | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 20.98%  | 3.22%     | 11.18%     | 2.35%         | 9.80%   | 0.87% |
| 过去六个月      | 78.24%  | 2.85%     | 51.03%     | 2.10%         | 27.21%  | 0.75% |
| 过去一年       | 123.73% | 2.83%     | 86.34%     | 2.06%         | 37.39%  | 0.77% |
| 自基金合同生效起至今 | 314.89% | 2.23%     | 199.56%    | 1.66%         | 115.33% | 0.57% |

#### 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

工银新能源汽车混合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



工银新能源汽车混合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、本基金基金合同于 2018 年 11 月 14 日生效。

2、根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的投资符合基金合同关于投资范围及投资限制的规定：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60% - 95%，其中投资于本基金界定的新能源汽车主题范围内的股票及存托凭证不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或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、应收申购款等。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|----------|------------------|------|--------|---|
|     |          | 任职日期             | 离任日期 |        |   |
| 闫思倩 | 本基金的基金经理 | 2018 年 11 月 14 日 | -    | 12 年   | 先后在华创证券担任高级分析师，在中银国际证券担任业务经理；2015 年加入工银瑞信，现任研究部基金经理，2017 年 10 月 17 日至今，担任工银瑞信生态环境行业股票型证券投资基金基金经理；2018 年 11 月 14 日至今，担任工银瑞信新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 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，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，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。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行，公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，制定了《公平交易管理办法》、《异常交易监控管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易

及交叉交易。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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% 的情况有 2 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 3 季度沪深 300 跌 6.85%，创业板跌 6.69%，中证新能源汽车指数涨 13.09%，新能源汽车基金 A 类份额上涨 21.1%。3 季度新能源汽车行业进入旺季，虽然行业下游需求仍然受汽车缺芯片的影响，但产销量依然逐月走高。欧洲销量也同比维持高增长，渗透率稳定在 20% 以上，显示出需求极大的韧性。美国销量也恢复明显，1-8 月已经实现去年全年的销量，同比持续高增长，大规模的经济刺激计划也将增加新能源汽车的补贴。Tesla 全球的产销量也不断创新高。板块总体跟随创业板反弹，行业上游化工的锂电池材料龙头和上游锂矿上涨较多。磷酸铁锂成为锂电池材料环节增速最快的细分赛道，铁锂份额加速上升。上游锂矿价格大幅上涨，在三季度一个季度实现接近翻倍增长。展望 10 月，中游需求依然走高，4 季度行业进入年底旺季。鉴于板块整体乐观的观点，基金整体仓位较高，总体超额收益回升。对于具体环节配置，继续看好行业基本面超预期的龙头，维持超配；同时看好上游仍然在涨价的锂矿、材料，受益于海外新能源汽车需求放量的全球产业链龙头，以及受益于上游涨价压力逐步触底的中游电池环节。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 份额净值增长率为 21.10%，本基金 C 份额净值增长率为 20.98%，业绩比较基准收益率为 11.18%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

## § 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 | 9,289,247,107.74 | 91.58        |

|   |                   |                   |        |
|---|-------------------|-------------------|--------|
|   | 其中：股票             | 9,289,247,107.74  | 91.58  |
| 2 | 基金投资              | -                 | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 182,078.00        | 0.00   |
|   | 其中：债券             | 182,078.00        | 0.00   |
|   | 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      | 640,692,396.02    | 6.32   |
| 8 | 其他资产              | 213,171,804.35    | 2.10   |
| 9 | 合计                | 10,143,293,386.11 | 100.00 |

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 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         | 18,116.82        | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 324,417,058.00   | 3.31         |
| C  | 制造业              | 8,808,249,882.63 | 89.81        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 145,175,538.00   | 1.48         |
| E  | 建筑业              | 28,483.92        | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 9,969,754.22     | 0.10         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | 40,233.44        | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 331,869.01       | 0.00         |
| J  | 金融业              | 112,849.20       | 0.00         |
| K  | 房地产业             | 8,705.25         | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 594,199.17       | 0.01         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 228,347.02       | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 72,071.06        | 0.00         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 9,289,247,107.74 | 94.71        |



注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 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 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  | 002466 | 天齐锂业 | 8,416,695 | 854,967,878.10 | 8.72         |
| 2  | 002812 | 恩捷股份 | 2,554,700 | 715,622,564.00 | 7.30         |
| 3  | 300014 | 亿纬锂能 | 6,515,624 | 645,242,244.72 | 6.58         |
| 4  | 002594 | 比亚迪  | 2,340,757 | 584,042,279.07 | 5.95         |
| 5  | 002460 | 赣锋锂业 | 2,986,207 | 486,572,568.58 | 4.96         |
| 6  | 002240 | 盛新锂能 | 6,699,746 | 399,572,851.44 | 4.07         |
| 7  | 002192 | 融捷股份 | 2,439,226 | 324,417,058.00 | 3.31         |
| 8  | 300390 | 天华超净 | 2,344,500 | 251,682,075.00 | 2.57         |
| 9  | 002497 | 雅化集团 | 7,585,600 | 251,083,360.00 | 2.56         |
| 10 | 603026 | 石大胜华 | 806,509   | 244,412,552.45 | 2.49         |

## 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） | 182,078.00 | 0.00         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 182,078.00 | 0.00         |

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 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  | 118002 | 天合转债 | 1,300 | 182,078.00 | 0.00         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

## 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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 3,210,530.96   |
| 2  | 应收证券清算款 | 24,274,716.01  |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 155,054.53     |
| 5  | 应收申购款   | 185,531,502.85 |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 213,171,804.35 |

### 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处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 工银新能源汽车混合 A      | 工银新能源汽车混合 C      |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 898,527,787.75   | 975,062,483.06   |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,353,845,288.90 | 1,602,728,421.08 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,052,145,644.08 | 1,439,003,188.38 |
| 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               | 1,200,227,432.57 | 1,138,787,715.76 |

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予工银瑞信新能源汽车主题混合型证券投资基金募集申请的注册文件；
- 2、《工银瑞信新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《工银瑞信新能源汽车主题混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《工银瑞信新能源汽车主题混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告。

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

工银瑞信基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日