

**博时新能源汽车主题混合型证券投资基金**  
**2022 年第 1 季度报告**  
**2022 年 3 月 31 日**

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年四月二十二日

## §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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 4 月 20 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	博时新能源汽车主题混合	
基金主代码	011938	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 2 日	
报告期末基金份额总额	316,469,716.67 份	
投资目标	本基金主要投资于新能源汽车主题的上市公司股票。在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、其他资产投资策略三个部分内容。其中，资产配置策略即根据经济周期决定权益类证券和固定收益类证券的投资比例。其次，股票投资策略包括个股投资策略、行业配置策略、交易策略、港股通投资策略和存托凭证投资策略。其他资产投资策略有债券投资策略、衍生产品投资策略、资产支持证券投资策略、融资业务投资策略。	
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×70%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%。	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。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	博时基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	博时新能源汽车主题混合 A	博时新能源汽车主题混合 C
下属分级基金的交易代码	011938	011939

报告期末下属分级基金的份 额总额	136,435,748.93 份	180,033,967.74 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 (2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日)	
	博时新能源汽车主题混合 A	博时新能源汽车主题混合 C
1.本期已实现收益	-7,639,069.79	-10,494,625.72
2.本期利润	-25,553,253.90	-34,168,673.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1908	-0.1912
4.期末基金资产净值	134,287,205.38	176,321,396.42
5.期末基金份额净值	0.9843	0.9794

注：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。

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 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

###### 1. 博时新能源汽车主题混合A：

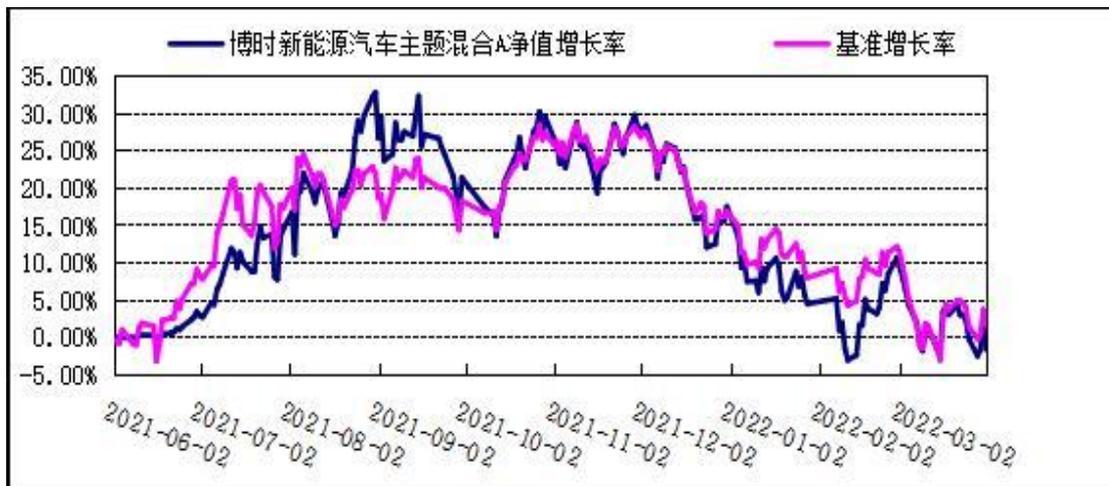
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-16.24%	2.17%	-13.07%	1.87%	-3.17%	0.30%
过去六个月	-18.91%	2.05%	-14.07%	1.65%	-4.84%	0.40%
自基金合同 生效起至今	-1.57%	2.10%	1.65%	1.82%	-3.22%	0.28%

###### 2. 博时新能源汽车主题混合C：

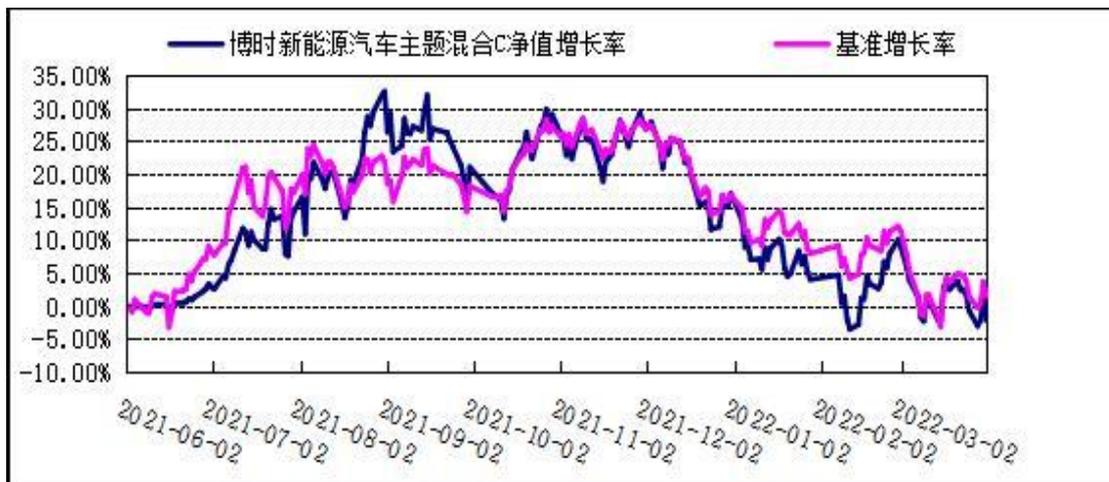
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-16.37%	2.17%	-13.07%	1.87%	-3.30%	0.30%
过去六个月	-19.16%	2.05%	-14.07%	1.65%	-5.09%	0.40%
自基金合同 生效起至今	-2.06%	2.10%	1.65%	1.82%	-3.71%	0.28%

### 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

#### 1. 博时新能源汽车主题混合A:



#### 2. 博时新能源汽车主题混合C:



注：本基金的基金合同于 2021 年 6 月 2 日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §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		
郭晓林	权益投资四部投资总监助理/基金经理	2021-06-02	-	9.7	郭晓林先生，硕士。2012 年从清华大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、高级研究员、高级研究员兼基金经理助理、资深研究员

					兼基金经理助理、资深研究员兼投资经理。现任权益投资四部投资总监助理兼博时互联网主题灵活配置混合型证券投资基金(2016年7月20日—至今)、博时汇悦回报混合型证券投资基金(2020年2月20日—至今)、博时创业板两年定期开放混合型证券投资基金(2020年9月3日—至今)、博时新能源汽车主题混合型证券投资基金(2021年6月2日—至今)、博时新能源主题混合型证券投资基金(2021年8月24日—至今)、博时移动互联网主题混合型证券投资基金(2021年9月29日—至今)、博时专精特新主题混合型证券投资基金(2021年12月6日—至今)的基金经理。
唐晟博	基金经理	2021-12-09	-	4.7	唐晟博先生，硕士。2017年从北京大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司。历任研究员、研究员兼基金经理助理、高级研究员兼基金经理助理。现任博时新能源汽车主题混合型证券投资基金(2021年12月9日—至今)的基金经理。

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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 6 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的

反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

22 年一季度整体市场呈下跌趋势，科技、消费、新能源和机械军工等中游制造业均出现较大幅度的下跌，低估值的煤炭、银行板块表现较好，背后的驱动力是市场预期在稳增长的目标下，托底经济的政策会发力。从风格上，中小盘股票相较于中大盘股票表现更好。尽管市场有各种波动，但我们选择股票依然坚持从产业赛道足够长，中期景气度能持续上行的行业中，寻找核心竞争优势明显，公司治理结构较好，财务质量较高的优质龙头企业。在过去的一年中，许多制造业企业享受了全球经济复苏以及中国在全球份额提升带来的较快增长，但从四季度开始我们已经看到部分行业的景气度开始变弱，在较高的基数下，22 年能继续保持高景气的行业也在减少，因此我们在组合上做了更多的精简，集中到少数能够维持高景气的子领域。报告期内，新能源板块下跌幅度较大，组合净值也有明显回撤。在宏观经济层面，我们预期将会有更多托底经济的政策出现，并能在二季度看到更多积极的数据信号。另一方面，在国际上，大宗商品上涨带来的通胀压力持续超预期，因而美联储持续加大力度收紧是不可避免的，另外上游资源供应的持续紧张也会挤压中下游的利润，直至需求转弱。从股票市场层面，当前中大盘股票的估值已经回落至历史中枢以下，中小盘成长与价值估值也接近历史低点，在这样的位置上，我们应更积极寻找机会，而非担忧风险。我们依然持续看好新能源行业，考虑到行业的增长速度，与历史上类似的新兴产业相比，无论是从相对还是绝对估值的角度，这些板块整体都处于估值较低的位置。我们将继续从中长期产业竞争格局以及公司核心优势角度出发，找到行业内能持续超越同业的企业，我们相信在当前的位置下，我们可以争取获得行业 beta 和公司 alpha 的双重收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 03 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.9843 元，份额累计净值为 0.9843 元，本基金 C 类基金份额净值为 0.9794 元，份额累计净值为 0.9794 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 -16.24%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 -16.37%，同期业绩基准增长率为 -13.07%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §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	270,314,573.79	86.04
	其中：股票	270,314,573.79	86.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	66,137.96	0.02
	其中：债券	66,137.96	0.02
	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	43,278,946.13	13.78
8	其他各项资产	515,593.14	0.16
9	合计	314,175,251.02	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	2,832,728.32	0.91
C	制造业	260,414,437.16	83.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	927,121.00	0.30
F	批发和零售业	38,203.56	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	16,541.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,755,865.20	1.85
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,019.66	0.00
M	科学研究和技术服务业	260,400.31	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	18,533.54	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,692.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	16,031.05	0.01
S	综合	-	-
	合计	270,314,573.79	87.03

### 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	002709	天赐材料	271,600	25,530,400.00	8.22
2	300750	宁德时代	45,500	23,309,650.00	7.50
3	603799	华友钴业	214,100	20,938,980.00	6.74
4	002812	恩捷股份	62,800	13,816,000.00	4.45
5	002466	天齐锂业	150,400	12,241,056.00	3.94
6	300014	亿纬锂能	144,200	11,632,614.00	3.75
7	603806	福斯特	77,100	8,750,079.00	2.82
8	002756	永兴材料	71,400	8,469,468.00	2.73
9	002460	赣锋锂业	66,400	8,343,160.00	2.69
10	002459	晶澳科技	97,000	7,631,960.00	2.46

### 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）	66,137.96	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	66,137.96	0.02

### 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	113053	隆 22 转债	540	66,137.96	0.02

### 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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	182,951.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	332,641.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	515,593.14

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时新能源汽车主题混合A	博时新能源汽车主题混合C
本报告期期初基金份额总额	131,327,207.41	178,531,216.20
报告期期间基金总申购份额	27,038,779.86	39,185,619.95

减：报告期期间基金总赎回份额	21,930,238.34	37,682,868.41
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	136,435,748.93	180,033,967.74

## §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

基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

## §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

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2022 年 3 月 31 日，博时基金公司共管理 322 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 15830 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模 5144 亿元人民币，累计分红逾 1627 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

## §9 备查文件目录

---

### 9.1 备查文件目录

- 9.1.1 中国证券监督管理委员会批准博时新能源汽车主题混合型证券投资基金设立的文件
- 9.1.2 《博时新能源汽车主题混合型证券投资基金基金合同》
- 9.1.3 《博时新能源汽车主题混合型证券投资基金托管协议》
- 9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 博时新能源汽车主题混合型证券投资基金各年度审计报告正本

9.1.6 报告期内博时新能源汽车主题混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司

二〇二二年四月二十二日