

安信新能源主题股票型发起式证券投资基金
2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 19 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	安信新能源主题股票型发起
基金主代码	015707
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 26 日
报告期末基金份额总额	34,644,040.53 份
投资目标	本基金主要投资于新能源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	1、资产配置策略。本基金通过对国内外宏观经济及证券市场整体走势进行前瞻性研究，紧密跟踪资金流向、市场流动性、交易特征和投资者情绪等因素，兼顾经济增长的长期趋势和短期经济周期的波动，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，对未来各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、股票投资策略。本基金所定义的新能源主题为从事新能源生产、新能源应用和新能源产业链配套服务相关的公司，包括太阳能、光伏、风能、核能、水能、地热能、生物质能、绿色照明、海洋能、垃圾发电、氢能、锂电池、储能、智能电网、电力设备及系统、智慧能源系统新能源设备制造及原材料、新能源电站工程服务、新能源汽车、新能源汽车电子及新能源相关的电子零部件、相关的上游资源。投资标的涵盖新能源产业链的上、中、下游。本基

	<p>金投资的新能源主题相关行业股票包括目前主营业务从事上述领域的公司股票。</p> <p>3、债券投资策略。本基金将采取自上而下的投资策略，通过深入分析宏观经济、货币政策、利率水平、物价水平以及风险偏好的变化趋势，从而确定债券的配置数量与结构。</p> <p>4、衍生品投资策略。在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与股指期货、国债期货和股票期权等金融工具的投资。</p> <p>5、资产支持证券投资策略。本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行资产支持证券产品的投资。</p> <p>6、融资业务策略。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。</p>
业绩比较基准	中证新能源指数收益率×80%+恒生综合指数收益率(经汇率调整后)×5%+中债综合(全价)指数收益率×15%
风险收益特征	<p>本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。根据《证券期货投资者适当性管理办法》及其配套规则，基金管理人及本基金其他销售机构将定期或不定期对本基金产品风险等级进行重新评定，因而本基金的产品风险等级具体结果应以各销售机构提供的最新评级结果为准。</p> <p>本基金除了投资 A 股外，还可通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	安信新能源主题股票型发起 A 安信新能源主题股票型发起 C
下属分级基金的交易代码	015707 015708
报告期末下属分级基金的份额总额	20,397,410.28 份 14,246,630.25 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 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）	
	安信新能源主题股票型发起 A	安信新能源主题股票型发起 C
1. 本期已实现收益	-297,907.98	-228,952.85
2. 本期利润	-198,718.84	-157,968.07
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0097	-0.0108

4. 期末基金资产净值	18,308,610.32	12,760,014.50
5. 期末基金份额净值	0.8976	0.8957

注：1、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。

2、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。

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

安信新能源主题股票型发起 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	-1.06%	1.40%	-5.26%	1.58%	4.20%	-0.18%
自基金合同生效起至今	-10.24%	1.14%	-18.86%	1.58%	8.62%	-0.44%

安信新能源主题股票型发起 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	-1.18%	1.40%	-5.26%	1.58%	4.08%	-0.18%
自基金合同生效起至今	-10.43%	1.14%	-18.86%	1.58%	8.43%	-0.44%

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

安信新能源主题股票型发起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



安信新能源主题股票型发起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、本基金合同生效日为 2022 年 7 月 26 日，截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截止本报告期末，本基金仍处于建仓期。

§ 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		
陈思	本基金的基金经理	2022 年 7 月 26 日	-	7 年	陈思女士，管理学硕士，曾任安信基金管理有限责任公司研究部研究员、特定资产

					管理部投资经理，现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。现任安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理，安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的“任职日期”、“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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销售机构监督管理办法》、《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信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

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》和公司制定的公平交易相关制度，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

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行为。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不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年四季度新能源板块继续小幅下跌，但我们仍然对新能源行业的长期发展抱有信心。新能源长期空间依然广阔，行业中的很多优秀公司的估值已经进入相对适宜的区间。如果新能源板块继续下跌，反而为我们提供了以更低价买入好公司的机会。

在新能源行业内部，四季度各个子板块之间的分化相对三季度有所收窄。

关于电动车，市场对短期有很多担心，担心碳酸锂价格高位、挤压下游利润，也担心 2023 年中国、欧洲、美国等重点市场的需求看不清楚。但好在电动车在全球的渗透率尚处于较低水平，未来发展空间并未变化，而短期问题会随着发展慢慢解决，电池技术和智能化的持续进步会进一步打开渗透率，碳酸锂的价格随着供给释放和回收技术成熟也会回归正常水平。现在电动车产业链中的很多优秀公司的市盈率仍然较低，我们认为站在长期的产业视角，已经非常具备性价比。

光伏板块在四季度下跌相对更多，主要因为硅料降价后下游有观望、博弈情绪，产业链的排产低于预期，且市场担心产业链快速降价会给公司带来库存损失。但我们认为库存损失尚在可控范围内且只是短期影响，从长期来看硅料降价有利于需求放量、有利于行业长期的健康发展。至于近期美国对于中国光伏企业的各种限制措施，我们认为中国的光伏产业比较优势仍然很强，且龙头企业对于贸易摩擦都有多年的应对经验。总体而言，光伏板块成长的确定性仍然很强。

风电行业，2022 年招标量超预期，会对应到 2023 年风机装机量的高速增长，风电企业 2023 年业绩增长的确定性非常强。但是风电长期的增长空间不及光伏和电动车，仍需紧密跟踪 2023 年的招标情况。部分估值较低的优秀公司值得布局。

储能板块在四季度经历了大幅下跌和反弹。从短期业绩增速来看，储能仍然是景气度最高的细分领域，市场也相应给予了较高的预期和估值。我们看好储能行业的长期前景，会紧密地跟踪行业内公司的竞争优势及格局的变化，仔细筛选估值合适的标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信新能源主题股票型发起 A 基金份额净值为 0.8976 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.06%；安信新能源主题股票型发起 C 基金份额净值为 0.8957 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.18%；同期业绩比较基准收益率为-5.26%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且基金合同生效未满 3 年，故报告期不存在需要说明的情况。

§ 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	27,117,564.47	86.84
	其中：股票	27,117,564.47	86.84
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	4,092,674.82	13.11
8	其他资产	17,308.72	0.06
9	合计	31,227,548.01	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 2,615,181.91 元，占净值比例 8.42%。

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	24,502,382.56	78.87
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	-	-
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	24,502,382.56	78.87

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	906,445.73	2.92

原材料	336,619.87	1.08
工业	-	-
非日常生活消费品	1,372,116.31	4.42
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	2,615,181.91	8.42

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	300750	宁德时代	7,900	3,108,018.00	10.00
2	601012	隆基绿能	71,700	3,030,042.00	9.75
3	603799	华友钴业	38,800	2,158,444.00	6.95
4	002459	晶澳科技	31,000	1,862,790.00	6.00
5	603218	日月股份	73,600	1,494,080.00	4.81
6	688680	海优新材	7,109	1,317,297.70	4.24
7	600885	宏发股份	38,000	1,269,580.00	4.09
8	002850	科达利	10,600	1,259,386.00	4.05
9	01211	比亚迪股份	6,500	1,118,284.71	3.60
10	605183	确成股份	57,000	1,076,730.00	3.47

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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合约。

5.9.2 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，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，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

本基金的国债期货投资根据风险管理原则，以套期保值为目的，以对冲风险为主。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。

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合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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

报告期内本基金投资的前十名证券除比亚迪股份（代码：01211 HG）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1. 比亚迪股份有限公司

2022 年 5 月 6 日，比亚迪股份有限公司因未依法履行职责被深圳市公安局大鹏分局消防监督管理大队处以罚款。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,660.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,648.64
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	17,308.72

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债券。

5.11.4 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。

5.11.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信新能源主题股票型发起 A	安信新能源主题股票型发起 C
报告期期初基金份额总额	20,490,519.28	15,122,862.06
报告期期间基金总申购份额	111,589.10	328,690.02
减：报告期期间基金总赎回份额	204,698.10	1,204,921.83
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	20,397,410.28	14,246,630.25

§ 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

项目	安信新能源主题股票型发起 A	安信新能源主题股票型发起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	10,001,444.44
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	-	10,001,444.44
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-	28.87

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,444.44	28.87	10,001,444.44	28.87	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,444.44	28.87	10,001,444.44	28.87	-

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20221001-20221231	10,001,444.44	-	-	10,001,444.44	28.87

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性

风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信新能源主题股票型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信新能源主题股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信新能源主题股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信新能源主题股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其它文件。

10.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2023 年 1 月 19 日