

东方新能源汽车主题混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

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：二〇一九年十月二十三日

§ 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 2019 年 10 月 22 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 2019 年 7 月 1 日起至 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
交易代码	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	27,375,655.25 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	东方基金管理有限责任公司
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（2019年7月1日—2019年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,620,982.20
2. 本期利润	374,211.17
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0137
4. 期末基金资产净值	29,355,826.25
5. 期末基金份额净值	1.0723

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。

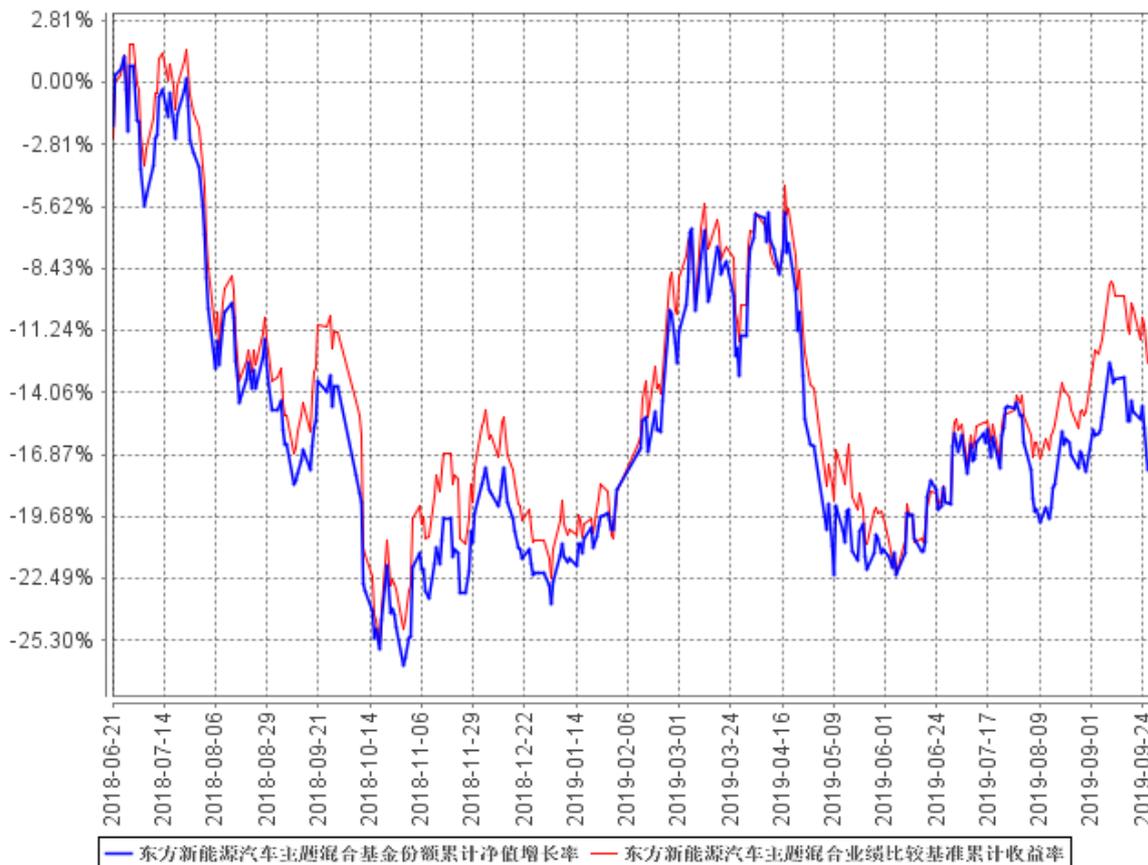
3.2 基金净值表现

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

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	1.20%	1.14%	7.60%	1.08%	-6.40%	0.06%

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基金份额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：本基金基金合同于 2018 年 6 月 21 日生效，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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		
李瑞（先生）	本基金基金经理	2018 年 6 月 21 日	-	8 年	中国人民大学金融学硕士，8 年证券从业经历。2011 年 7 月加盟东方基金管理有限责

					任公司，曾任权益投资部研究员，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、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。
--	--	--	--	--	--

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《证券投资基金管理公司管理办法》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《东方基金管理有限责任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内的公平交易程序；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 报告期内基金投资策略和运作分析

自上而下看，市场关注的焦点在经济下行压力、国内对冲政策等方面，而这些因素不确定性都很大。自下而上看，分化或分层是市场最大最确定的特点，一批具有宽厚的护城河、竞争优势突出、治理完善、财报优异的公司，无论内外部环境如何，都在不断创造价值并不断被越来越多的投资者认可。究其原因，市场的时代背景已经从总量波动为主变成了结构分化为主，大批优质公司走上了强者恒强的路。同时，投资者结构也正在发生机构化和国际化的深刻变化，正在发生质变，而这一趋势还在持续。

短期来看，市场仍然面临着经济下行、国内对冲政策等的干扰，但是市场的核心逻辑已经不是过去过度关注宏观、总量，从而追求贝塔，而更重要的是对优质公司的价值判断。

CS 新能源车（399976）涨幅远落后于大盘，主要原因是行业补贴退坡的压力叠加了汽车市场的不景气，对行业造成较大冲击。而行业补贴退坡的过程是加速优胜劣汰的过程，龙头企业竞争力日益凸显。我们的投资方向始终坚持围绕消费升级、全球供应这一主线，投资于具备全球竞争力的产业链龙头，投资于优质资产，未来我们也将继续秉承这一理念。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 9 月 30 日，本基金净值增长率为 1.20%，业绩比较基准收益率为 7.60%，低于业绩比较基准 6.40%。

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，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况，本基金管理人已将此情况上报中国证监会并拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。

§ 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	23,414,048.06	76.96
	其中：股票	23,414,048.06	76.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,007,100.00	3.31
	其中：债券	1,007,100.00	3.31
	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	5,689,788.35	18.70
8	其他资产	312,073.25	1.03
9	合计	30,423,009.66	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	-	-
C	制造业	22,539,048.06	76.78
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	875,000.00	2.98
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	23,414,048.06	79.76

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	300450	先导智能	40,000	1,348,000.00	4.59
2	603799	华友钴业	50,000	1,345,500.00	4.58
3	002050	三花智控	100,000	1,316,000.00	4.48
4	300750	宁德时代	18,000	1,287,000.00	4.38
5	002074	国轩高科	100,000	1,251,000.00	4.26
6	300073	当升科技	50,000	1,246,500.00	4.25
7	300014	亿纬锂能	36,000	1,094,040.00	3.73
8	603659	璞泰来	21,000	1,075,200.00	3.66
9	300037	新宙邦	40,000	1,012,800.00	3.45
10	600885	宏发股份	40,000	1,011,600.00	3.45

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	1,007,100.00	3.43
	其中：政策性金融债	1,007,100.00	3.43
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	1,007,100.00	3.43

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	108602	国开 1704	10,000	1,007,100.00	3.43
2	-	-	-	-	-
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受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有的国轩高科(002074)公司高级管理人员侯飞先生于2019年02月14日通过深圳证券交易所集中竞价交易系统减持公司股份5,000股,占公司总股本的0.0004%,成交均价为14.7元,成交金额为7.35万元。经公司自查,侯飞先生本次减持前最近一次交易公司股票时间为2018年7月2日,通过深圳证券交易所交易系统增持买进100,000股,本次减持前持有公司股份425,000股,占公司总股本的0.0374%,本次减持后持有公司股份420,000股,占公司总股本的0.0370%。本次减持行为未构成短线交易、未发生在股票交易敏感期内,亦不存在因获悉内幕信息而交易公司股票及主观获利的情形。

本次减持股票行为违反了《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》中关于董事、监事、高级管理人员通过集中竞价交易减持股份需提前15个交易日披露减持计划的规定。

2、该事项当前处理情况

1) 经与侯飞先生核实,因其本人工作繁忙,证券账户由其配偶代为管理,因其配偶对高管减持新规的程序性要求认识不足,因操作失误,在侯飞本人不知情的情况下进行了减持股票交易操作。

2) 在意识到上述情况构成违规减持后,侯飞先生主动向公司报告,进行了深刻的反省,并对本次违规减持公司股票行为给公司的负面影响深表歉意,对广大投资者致以诚恳的道歉,今后将加强对持有公司股票证券账户的管理,并严格遵守相关法律法规的规定。

3、对本次违规减持公司股份的致歉声明

侯飞先生:本人对本次违规买卖公司股票行为进行了深刻反省,并就本次行为向公司及广大投资者造成的负面影响深表歉意。本人会加强对相关法律法规、规范性文件学习,加强持有公司股票的证券账户管理,防止此类事件再次发生。

公司将以此为鉴,进一步加强组织董事、监事、高级管理人员以及持有公司股份5%以上的股东对《中华人民共和国证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等相关法律、法规的学习,并要求相关人员

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。

本基金所持有的亿纬锂能(300014)于2019年6月收到中国证券监督管理委员会广东监管局采取监管关注措施的处罚。主要违法违规事实：一、公司治理及内部控制存在的问题：(一)董事会及专门委员会会议记录不规范。公司部分董事会及下设委员会现场会议记录未由出席会议的董事签名确认，且相关会议记录也未记录每一决议事项的具体表决方式，不符合公司《董事会议事规则》的相关要求，且违反了《公司法》以及《上市公司章程指引(2006年修订)》等相关规定。(二)公司章程个别条款存在瑕疵。公司《公司章程》第一百一十一条规定独立董事连续三次未亲自出席董事会会议的由董事会提请股东大会予以撤换，而按照有关规定，董事连续两次未能亲自出席或委托其他董事出席董事会会议的，即应建议予以撤换。公司上述规定违反了《上市公司章程指引(2006年修订)》的相关规定。二、信息披露存在的问题：公司2012年年度报告未披露审计报告正文；超募资金投资项目锂离子电池生产线(扩产)项目2013年度已经投产并产生盈利，公司2013年年报募集资金项目情况“截止报告期末累积实现的效益”栏目为空白，未准确披露项目效益情况；2013年年报中披露审计意见时错误披露公司名称和会计期间。上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》和《公开发行证券的公司信息披露编报规则第30号-创业板上市公司年度报告的内容与格式》等相关规定。三、财务核算存在的问题：(一)未及时计提缴纳城市维护建设税和教育费附加。公司2010年6月至2011年12月期间未计提缴纳当期城市维护建设税和教育费附加合计221.21万元。公司于2012年5月进行补提，计入当月营业税金及附加科目并在当月缴纳，上述行为违反了《会计准则—基本准则》的相关规定。(二)会计基础工作不规范。包括：公司2011年12月收到政府补助拨款1,600万元，但记账凭证未附相关银行进账单据；公司2012年与佰特瑞及BSBPowerCompanyLimited(以下简称“BSB”)的交易中，在未发生产品入库和出库的情况下编制入库单和出库单，并以此确认销售收入。上述行为不符合《会计基础工作规范》的相关规定。四、内幕信息管理存在的问题：公司2012年年度报告内幕信息知情人档案未记录个别审计报告签字注册会计师和部分审计小组成员，违反了《关于上市公司建议内幕信息知情人登记管理制度的规定》的有关规定。以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

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。

本基金投资国轩高科主要基于以下原因：公司业务纯度高，主要产品是磷酸铁锂电池，为国内少数率先将乘用车磷酸铁锂 PACK 能量密度提升至 140Wh/kg 的企业之一，高能量密度意味高补贴，将对争取客户起到积极作用。随磷酸铁锂在乘用车回暖，公司有望迎来业绩拐点。

本基金投资亿纬锂能主要基于以下原因：公司现已成为中国锂电池行业的领先企业，已拥有 59 项国家专利且在相关行业拥有技术和生产规模优势，是具有国际先进技术水平的绿色高能锂电池全国主要供应商之一。在全球新能源产业不断升级的背景下，公司引进了先进的自动化生产设备和尖端的分析测试仪器，研发生产更高质量的产品。公司拥有一支以资深专家顾问组成的高素质研发团队，并采用中外高校研究机构合作的方式，确保公司始终保持走在行业前沿。

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有投资于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	160,509.79
2	应收证券清算款	61,047.80
3	应收股利	-
4	应收利息	19,166.36
5	应收申购款	71,349.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	312,073.25

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	27,161,869.35
报告期期间基金总申购份额	7,439,461.27
减：报告期期间基金总赎回份额	7,225,675.37
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	27,375,655.25

§ 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,971,108.18
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	6,971,108.18
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	25.46

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

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	20190910 - 20190924	0.00	6,095,925.21	6,095,925.21	0.00	0.00%
	2	20190910 - 20190923	0.00	5,079,768.31	5,079,768.31	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。</p>							

§ 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、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、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）查阅。

东方基金管理有限责任公司

2019 年 10 月 23 日