

建信智能汽车股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：建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 4 月 21 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 4 月 19 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	建信智能汽车股票
基金主代码	011793
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 10 日
报告期末基金份额总额	604,006,355.07 份
投资目标	本基金为股票型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，把握汽车产业智能化、电动化、网联化、共享化及衍生的投资机会，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	中证智能电动汽车指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债综合全价(总值)指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。
基金管理人	建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

§ 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-42,307,721.00
2. 本期利润	-10,201,553.56
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0159
4. 期末基金资产净值	479,154,801.94
5. 期末基金份额净值	0.7933

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。

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。

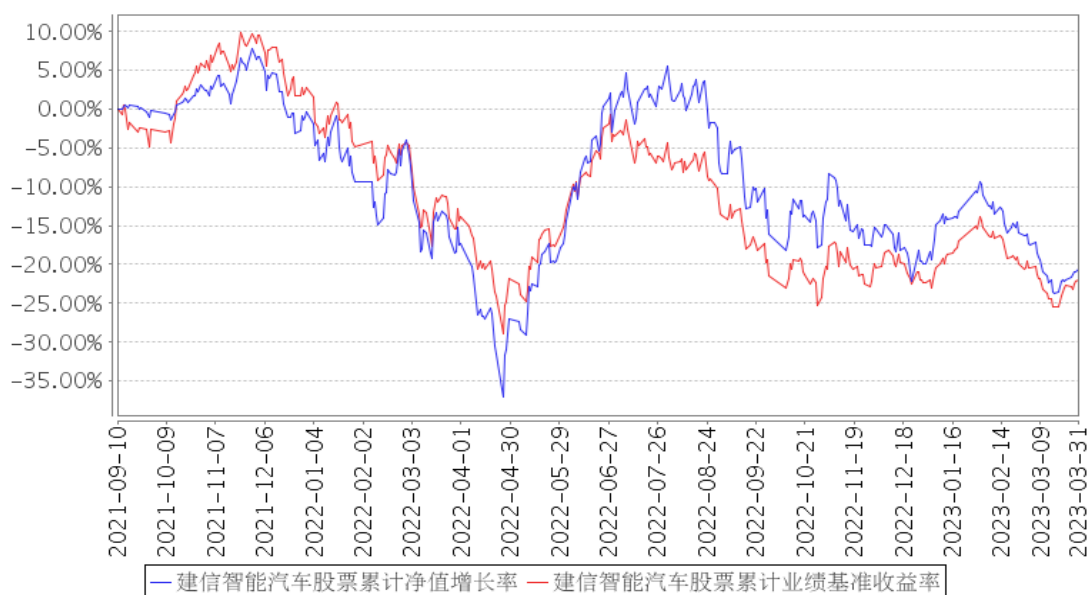
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-1.04%	1.15%	0.59%	0.94%	-1.63%	0.21%
过去六个月	-5.35%	1.51%	-0.67%	1.22%	-4.68%	0.29%
过去一年	-3.80%	1.95%	-8.81%	1.47%	5.01%	0.48%
自基金合同 生效起至今	-20.67%	1.84%	-21.97%	1.48%	1.30%	0.36%

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

建信智能汽车股票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：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

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		
张湘龙	本基金的基金经理	2021年9月10日	-	7	张湘龙先生，硕士。2015年7月毕业于北京大学经济学专业，同年7月加入建信基金研究部，历任助理研究员、初级研究员、行业研究员、高级行业研究员兼基金经理助理、基金经理。2021年2月1日起任建信新能源行业股票型证券投资基金的基金经理；2021年9月10日起任建信智能汽车股票型证券投资基金的基金经理。
田元泉	研究部副总经理，本基金的基金经理	2021年9月10日	-	10	田元泉先生，研究部副总经理（主持工作），硕士。2012年8月至2015年5月在安邦资产管理有限责任公司工作，历任研究员、投资经理助理。2015年6月加入建信基金管理有限责任公司，历任研究员、研究主管、资深研究员、研究部总经理助理、副总经理。2020年6月17日起

					任建信新能源行业股票型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 10 日起任建信智能汽车股票型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

无。

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，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信智能汽车股票型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度多重因素交织下全球股票市场普涨。权益资产方面，受美联储加息预期变化、欧美银行风险事件扰动等因素影响，全球权益资产普涨，且呈现海外强于国内的格局，上证指数上涨约 6% 处于中游水平。债券市场方面，美债利率冲高回落，国债利率窄幅震荡，中美利差倒挂幅度有所收窄，受国内经济改善、加息预期反复以及银行风险事件影响，人民币兑美元小幅升值，整体呈现宽幅震荡走势。

进入 4 月，市场将陆续迎来一季度全量宏观经济数据，将刻画完整的国内一季度实际宏观经济表现，同时叠加政治局会议定调未来政策导向、A 股财报披露、公募机构持仓等因素，将决定下一阶段市场整体风格。我们对市场后续走势保持相对乐观的判断，维持 3200-3400 震荡区间的判断没有变化。

智能汽车行业一季度经历先涨后跌，作为早周期行业，经济复苏预期在汽车板块有所体现，但基本面暂未有明显起色；从基本面来看，一季度行业产销淡季，部分车企品牌价格有一定调整，消费者存观望情绪，预计二三季度销量将启动上行。

本基金一季度仓位维持中性，产品加大了宏观更为相关的商用车板块配置，乘用车链条略有减仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-1.04%，波动率 1.15%，业绩比较基准收益率 0.59%，波动率 0.94%。

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	436,234,518.65	90.40
	其中：股票	436,234,518.65	90.40
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	46,140,231.44	9.56
8	其他资产	179,152.64	0.04
9	合计	482,553,902.73	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公允价值为 4,836,328.60 元，占期末基金资产净值比例为 1.01%。

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	4,833,519.40	1.01
C	制造业	394,373,110.74	82.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,647,766.00	0.97
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,500,363.86	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,266,981.33	1.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,767,182.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	8,474,121.76	1.77
N	水利、环境和公共设施管理业	6,241,595.59	1.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	293,549.37	0.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	431,398,190.05	90.03

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（%）
Materials 材料	-	-
Consumer Staples 日常生活消费品	-	-
Consumer Discretionary 非日常消费品	4,197,965.62	0.88
Energy 能源	-	-
Financials 金融	-	-
Health Care 医疗保健	-	-
Industrials 工业	-	-
Real Estate 房地产	-	-
Information Technology 信息技术	638,362.98	0.13
Telecommunication Services 通讯服务	-	-
Utilities 公用事业	-	-

合计	4,836,328.60	1.01
----	--------------	------

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	95,290	38,692,504.50	8.08
2	002594	比亚迪	70,160	17,962,363.20	3.75
3	001311	多利科技	174,041	16,441,653.27	3.43
4	002283	天润工业	2,221,800	12,864,222.00	2.68
5	688326	经纬恒润	92,112	11,978,244.48	2.50
6	300274	阳光电源	111,700	11,712,862.00	2.44
7	603799	华友钴业	184,428	10,143,540.00	2.12
8	600660	福耀玻璃	265,100	9,214,876.00	1.92
8	03606	福耀玻璃	18,840	564,051.17	0.12
9	300428	立中集团	360,582	9,674,415.06	2.02
10	603997	继峰股份	627,400	9,367,082.00	1.95

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	135,183.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	43,969.04
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	179,152.64

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。

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

报告期期初基金份额总额	609,067,847.59
报告期期间基金总申购份额	184,870,952.79
减：报告期期间基金总赎回份额	189,932,445.31
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	604,006,355.07

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§ 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

单位：份

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	2023 年 03 月 14 日 - 2023 年 03 月 31 日		-121,626,201.42		-121,626,201.42	20.14
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况，可能会出现因集中赎回而引发的基金流动性风险，敬请投资者注意。本基金管理人将不断完善流动性风险管控机制，持续做好基金流动性风险的管控工作，审慎评估大额申赎对基金运作的影响，采取有效措施切实保护持有人合法权益。							

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、中国证监会批准建信智能汽车股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信智能汽车股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信智能汽车股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信智能汽车股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

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。

建信基金管理有限责任公司

2023 年 4 月 21 日