

平安中证消费电子主题交易型开放式指数 证券投资基金发起式联接基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 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 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接
基金主代码	015894
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 19 日
报告期末基金份额总额	31,616,909.63 份
投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证消费电子主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金的目标 ETF 为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。
基金管理人	平安基金管理有限公司

基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 A	平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	015894	015895
报告期末下属分级基金的份额总额	12,635,885.20 份	18,981,024.43 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	561600
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 30 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 9 月 9 日
基金管理人名称	平安基金管理有限公司
基金托管人名称	中信建投证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	（一）股票（含存托凭证）投资策略 本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。特殊情况包括但不限于以下情形： （1）法律法规的限制； （2）标的指数成份股流动性严重不足； （3）标的指数的成份股票长期停牌； （4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，根据审慎原则合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 （二）债券和货币市场工具投资策略 本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。 （三）金融衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 2、国债期货投资策略 3、股票期权投资策略

	(四) 可转换债券及可交换债券投资策略 (五) 资产支持证券投资策略 (六) 融资与转融通证券出借业务投资策略 (七) 信用衍生品投资策略 (八) 未来, 随着证券市场投资工具的发展和丰富, 在履行适当程序后, 本基金可相应调整和更新相关投资策略, 并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	中证消费电子主题指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金, 其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金, 跟踪中证消费电子主题指数, 其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

§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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 A	平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 C
1. 本期已实现收益	-68,042.17	-108,631.57
2. 本期利润	-985,303.25	-1,346,078.86
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0776	-0.0838
4. 期末基金资产净值	11,091,506.44	16,580,209.12
5. 期末基金份额净值	0.8778	0.8735

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

平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 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	-8.08%	1.33%	-8.25%	1.35%	0.17%	-0.02%
过去六个月	-11.66%	1.44%	-12.31%	1.49%	0.65%	-0.05%

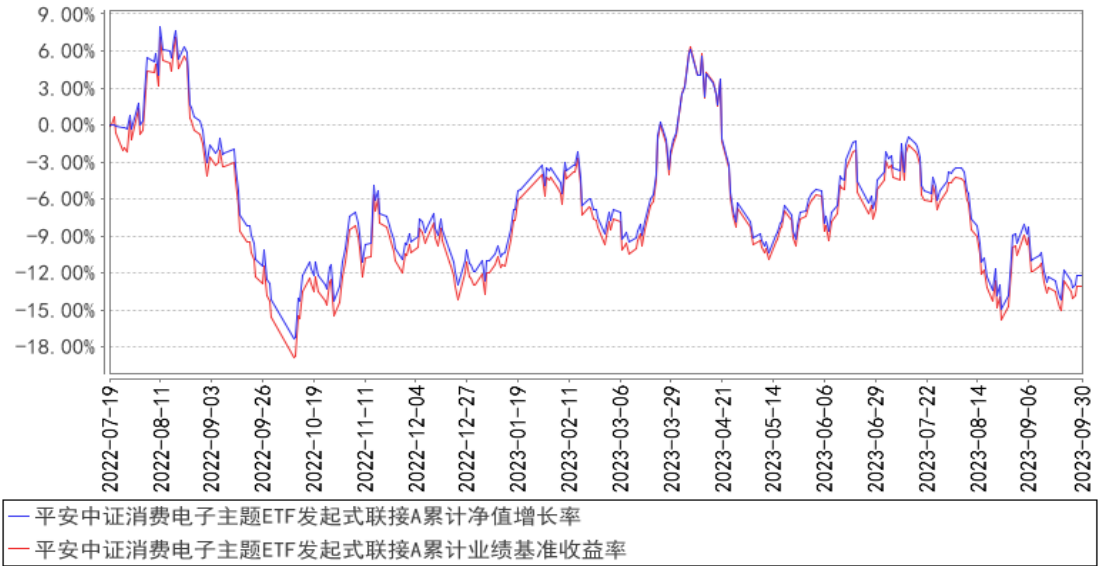
过去一年	2.27%	1.43%	2.99%	1.50%	-0.72%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-12.22%	1.42%	-13.08%	1.51%	0.86%	-0.09%

平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 C

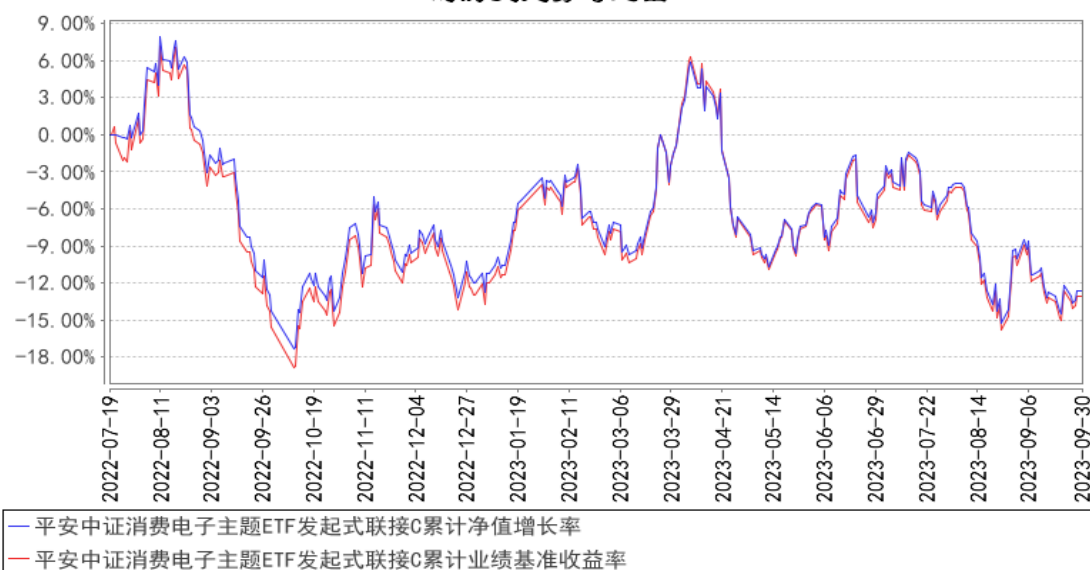
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-8.19%	1.33%	-8.25%	1.35%	0.06%	-0.02%
过去六个月	-11.85%	1.44%	-12.31%	1.49%	0.46%	-0.05%
过去一年	1.85%	1.43%	2.99%	1.50%	-1.14%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-12.65%	1.42%	-13.08%	1.51%	0.43%	-0.09%

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

平安中证消费电子主题ETF发起式联接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



平安中证消费电子主题ETF发起式联接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 2022 年 07 月 19 日正式生效；

2、按照本基金的基金合同规定，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，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§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		
王仁增	平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理	2023 年 4 月 6 日	-	9 年	王仁增先生，南开大学世界经济专业硕士研究生。曾先后担任财通基金管理有限公司产品经理、华安基金管理有限公司高级产品经理。2021 年 6 月加入平安基金管理有限公司，任 ETF 指数投资中心高级研究员、基金经理助理，现担任平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金基

					金经理。
钱晶	ETF 指数中心投资副总监，平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理	2022 年 7 月 19 日	2023 年 7 月 31 日	12 年	钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心投资经理。现任 ETF 指数中心投资副总监，同时担任平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认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。

4.1.1 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

注：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

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》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，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未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪，也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金在投资管理上，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 A 的基金份额净值 0.8778 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.08%，同期业绩比较基准收益率为-8.25%；截至本报告期末平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 C 的基金份额净值 0.8735 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.19%，同期业绩比较基准收益率为-8.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	26,246,506.44	93.32
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	1,732,458.55	6.16
8	其他资产	146,113.60	0.52
9	合计	28,125,078.59	100.00

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

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**

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	平安基金管理有限公司	26,246,506.44	94.85

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期无股指期货投资。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期无国债期货投资。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内无国债期货投资。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.12.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,532.90
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	139,580.70
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	146,113.60

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.12.6 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

项目	平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 A	平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 C
----	---------------------------	---------------------------

报告期期初基金份额总额	12,590,791.59	11,520,187.11
报告期期间基金总申购份额	499,310.73	18,715,199.76
减:报告期期间基金总赎回份额	454,217.12	11,254,362.44
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	12,635,885.20	18,981,024.43

§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	平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 A	平安中证消费电子主题 ETF 发起式联接 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,800.18	-
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	10,001,800.18	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	79.15	-

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§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	10,001,800.18	31.63	10,000,000.00	31.63	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	10,001,800.18	31.63	10,000,000.00	31.63	3 年

§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	2023/07/01--2023/09/30	10,001,800.18	-	-	10,001,800.18	31.63
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

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) 中国证监会准予平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集注册的文件

(2) 平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同

(3) 平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议

(4) 法律意见书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

10.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

10.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司
2023 年 10 月 25 日