

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 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告送出日期：2020 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 04 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 2020 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安中证新能源汽车产业 ETF
场内简称	新能车（扩位证券简称:新能车 ETF）
基金主代码	515700
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 31 日
报告期末基金份额总额	6,364,510,190.00 份
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	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。
业绩比较基准	中证新能源汽车产业指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票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	招商证券股份有限公司

§ 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（2020 年 1 月 1 日-2020 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-151,034,236.21
2. 本期利润	-1,573,602,417.31
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.4727
4. 期末基金资产净值	5,870,239,024.02
5. 期末基金份额净值	0.9223

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	-7.80%	3.02%	-6.37%	3.13%	-1.43%	-0.11%

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

平安中证新能源汽车产业ETF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、本基金合同于2019年12月31日生效，截至本报告期末基金成立未及半年；
- 2、截止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		
钱晶	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基金经理	2019年12月31日	—	8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，曾任资产

					配置事业部 ETF 指数部投 资经理。现任 平安中证沪港 深高股息精选 指数型证券投资 基金、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 MSCI 中国 A 股国际 交易型开放式 指数证券投资 基金联接基 金、平安 MSCI 中国 A 股国际 交易型开放式 指数证券投资 基金、平安创 业板交易型开 放式指数证券 投资基金、平 安中证人工智 能主题交易型 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、平安创业 板交易型开放 式指数证券投资 基金联接基 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。

4.2 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、《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

作为一只投资于中证新能源汽车产业公司的被动型产品，基金在投资管理上，采取完全复制的管理办法跟踪指数，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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9223 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.80%，业绩比较基准收益率为-6.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 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	5,799,616,172.05	98.37
	其中：股票	5,799,616,172.05	98.37
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	83,520,433.81	1.42
8	其他资产	12,660,135.07	0.21
9	合计	5,895,796,740.93	100.00

注：1、投资组合报表中股票投资市值与按行业分类股票投资组合报表中股票总市值之间的差异是由于可退替代款估值增值引起的；

2、本基金本报告期末参与转融通证券出借业务融出证券市值为 224,221,815，占基金资产净值比例 3.82%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	204,205,075.75	3.48
C	制造业	5,557,581,403.47	94.67
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	37,764,745.54	0.64
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	5,799,551,224.76	98.80

5.2.2 报告期末积极投资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	9,849.00	0.00
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	19,147.31	0.00
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	17,552.98	0.00
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	46,549.29	0.00

5.2.3 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 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

5.3.1 报告期末指数投资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	4,754,076	572,343,209.64	9.75

2	002594	比亚迪	7,567,844	453,843,604.68	7.73
3	600104	上汽集团	19,429,666	398,308,153.00	6.79
4	002460	赣锋锂业	6,391,043	257,239,480.75	4.38
5	300014	亿纬锂能	4,043,200	234,950,352.00	4.00
6	300124	汇川技术	8,665,538	224,004,157.30	3.82
7	603993	洛阳钼业	58,848,725	204,205,075.75	3.48
8	002050	三花智控	11,527,121	185,240,834.47	3.16
9	000625	长安汽车	16,245,003	171,872,131.74	2.93
10	300450	先导智能	4,417,884	165,493,934.64	2.82

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603353	和顺石油	689	19,147.31	0.00
2	300825	阿尔特	1,642	17,552.98	0.00
3	002979	雷赛智能	1,005	9,849.00	0.00

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投资。

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投资。

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：本基金本报告期末无权证投资。

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.11 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。

5.11.2 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	8,178,026.17
2	应收证券清算款	4,258,908.94
3	应收股利	—
4	应收利息	170,503.07
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	52,696.89
9	合计	12,660,135.07

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603353	和顺石油	19,147.31	0.00	新股未上市
2	002979	雷赛智能	9,849.00	0.00	新股未上市

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	288,510,190.00
报告期期间基金总申购份额	8,391,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	2,315,000,000.00
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	6,364,510,190.00

§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

注：无

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予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设立的文件
- （2）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基金合同
- （3）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托管协议
- （4）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(5) 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 2020 年第 1 季度报告原文

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

8.3 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：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2020 年 4 月 21 日