

平安先进制造主题股票型发起式证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 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 2024 年 07 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 2024 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安先进制造主题股票发起	
基金主代码	019457	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 10 月 24 日	
报告期末基金份额总额	150,769,636.59 份	
投资目标	本基金主要投资先进制造主题相关股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	(一) 大类资产配置策略；(二) 股票投资策略：1、先进制造主题的界定；2、先进制造主题投资策略；3、港股通标的股票投资策略；4、存托凭证的投资策略；(三) 债券投资策略；(四) 股指期货投资策略；(五) 国债期货投资策略；(六) 股票期权投资策略；(七) 资产支持证券投资策略；(八) 信用衍生品投资策略；(九) 可转换债券及可交换债券投资策略	
业绩比较基准	中证智能制造主题指数收益率 \times 85% + 中证全债指数收益率 \times 10% + 恒生指数收益率（经汇率调整） \times 5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金若投资港股通标的股票，需承担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。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
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	平安先进制造主题股票发起	平安先进制造主题股票发起

	A	C
下属分级基金的交易代码	019457	019458
报告期末下属分级基金的份额总额	12,886,543.74 份	137,883,092.85 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	平安先进制造主题股票发起 A	平安先进制造主题股票发起 C
1. 本期已实现收益	140,199.90	375,629.77
2. 本期利润	-1,344,479.14	-13,345,619.70
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1026	-0.1361
4. 期末基金资产净值	10,652,933.16	113,530,398.18
5. 期末基金份额净值	0.8267	0.8234

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

平安先进制造主题股票发起 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	-11.26%	1.72%	-2.72%	1.26%	-8.54%	0.46%
过去六个月	-18.95%	1.96%	-5.63%	1.59%	-13.32%	0.37%
自基金合同 生效起至今	-17.33%	1.70%	-2.70%	1.47%	-14.63%	0.23%

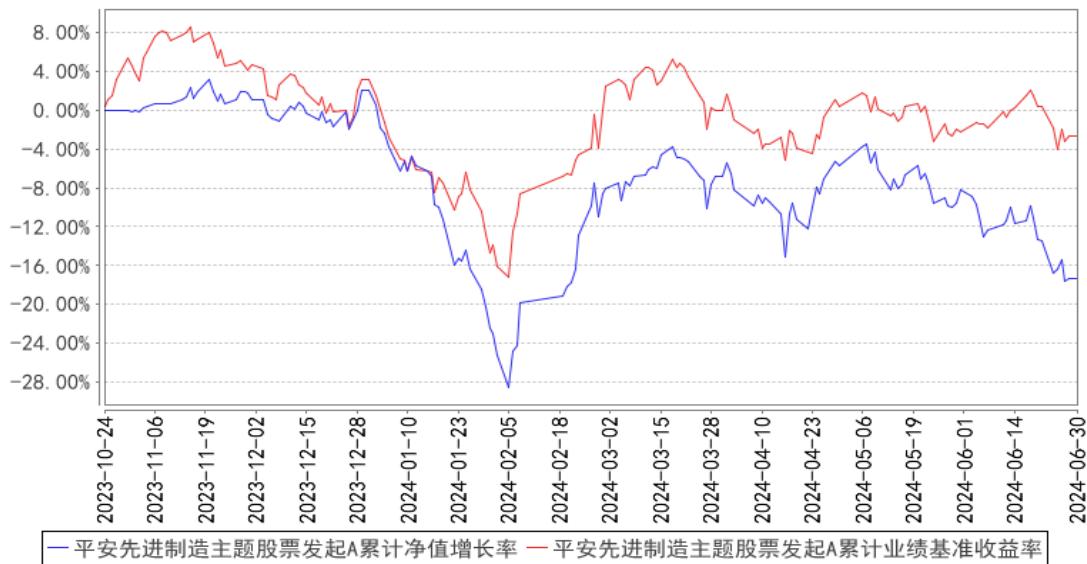
平安先进制造主题股票发起 C

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

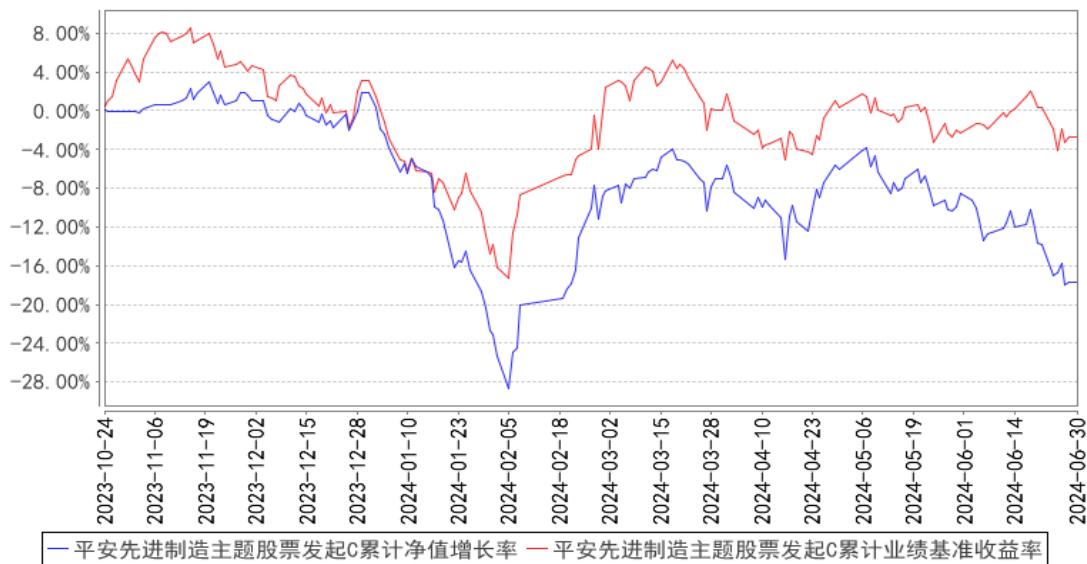
过去三个月	-11.40%	1.72%	-2.72%	1.26%	-8.68%	0.46%
过去六个月	-19.18%	1.96%	-5.63%	1.59%	-13.55%	0.37%
自基金合同生效起至今	-17.66%	1.70%	-2.70%	1.47%	-14.96%	0.23%

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

平安先进制造主题股票发起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



平安先进制造主题股票发起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、本基金基金合同于 2023 年 10 月 24 日正式生效，截至报告期末未满一年；
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		
张荫先	平安先进 制造主题 股票型发 起式证券 投资基金 基金经理	2023 年 10 月 24 日	-	9 年	张荫先先生，华南理工大学车辆工程专业硕士，曾担任广州汽车集团股份有限公司汽车工程研究院动力总成项目主管工程师、深圳国家高技术产业创新中心副部长、西南证券股份有限公司研发中心高级分析师。2018 年 6 月加入平安基金管理有限公司，任资深研究员，同时任平安先进制造主题股票型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首位基金经理，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；对此后的非首位基金经理，“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遵规守信情况的说明

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 2024 年二季度主要配置维持在人形机器人方向，此外部分仓位配置在通用设备、出海链、工具类消费品、自主可控等方向。

诚然，如果把时间轴回拨至 2022-2023 年，当马斯克在 AIDay 展出 Optimus 擎天柱原型机以及后续陆续发布擎天柱迭代训练视频的时候，当时市场的预期较为乐观，预计 2023 年至 2024 年上半年会有人形机器人相关零部件的定点事件催化甚至量产，因此前两年机器人板块的表现较为活跃。而步入 2024 年后，由于机器人实际的进展比预期慢，导致今年上半年板块跌幅较大。但我们相信在人工智能快速迭代发展、人力成本持续上升、人类一直追求美好生活的不可逆趋势下，人形机器人只会迟到，而不会不到。乐观方面看，英伟达 CEO 近期也提到机器人技术将在未来 2 到 3 年内取得重大突破，而马斯克也提到将在明年部署超过 1000 台 Optimus 机器人。因此板块回调后，我们希望投资者可以更为积极。

今年 3 月份英伟达 GTC 大会所推出的 GROOT 项目，将为人形机器人制造商提供一整套的开发工具平台，我们认为该平台可以类比智能手机时代的安卓系统与高通或联发科芯片的组合，会加速机器人的迭代开发，包括我们今年所看到的 Figure01、宇树、波士顿动力等等，他们的迭代进步速度不亚于特斯拉擎天柱机器人。另外，我国汽车产业出口量也已经跃居世界第一，所依靠的正是我国一大批优质的制造企业，他们具备批量化、高一致性以及快速响应的能力，这方面的能力及优势是可以在机器人赛道、低空经济等新质生产力赛道中得到复用，因此也蕴藏着很好的投资机会。

在看好机器人产业的同时，本产品也会选择部分仓位布局其他先进制造领域中具有性价比的股票，包括通用设备、工具类消费品、自主可控等方向。近几年全球各国在重塑制造业回流，目前基本已经完成了厂房、道路等基建项目，后续开始购置生产性设备，而通用设备由于普适性、通用性以及部分公司具有海外产能，其脱钩的风险相对较低。此外在当今复杂的国际关系背景下，国内自主可控、解决卡脖子工程会更受重视，包括数控系统、科学仪器等，因此这类公司经

历回调后也提供了不错的买入机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安先进制造主题股票发起 A 的基金份额净值 0.8267 元, 本报告期基金份额净值增长率为-11.26%, 同期业绩比较基准收益率为-2.72%; 截至本报告期末平安先进制造主题股票发起 C 的基金份额净值 0.8234 元, 本报告期基金份额净值增长率为-11.40%, 同期业绩比较基准收益率为-2.72%。

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	112,762,308.19	85.57
	其中: 股票	112,762,308.19	85.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	406,246.03	0.31
	其中: 债券	406,246.03	0.31
	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	17,102,253.09	12.98
8	其他资产	1,499,472.74	1.14
9	合计	131,770,280.05	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 7,490,182.22 元, 占净值比例 6.03%。

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	103,321,141.97	83.20
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	1,950,984.00	1.57
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	105,272,125.97	84.77

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(%)
原材料	-	-
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	-	-
能源	2,039,839.80	1.64
金融	-	-
医疗	-	-
工业	5,450,342.42	4.39
地产业	-	-
信息科技	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	7,490,182.22	6.03

注：以上分类采用全球行业分类标准。

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	002050	三花智控	325,500	6,210,540.00	5.00
2	601689	拓普集团	115,400	6,186,594.00	4.98

3	003021	兆威机电	122,900	5,671,835.00	4.57
4	300580	贝斯特	382,638	5,624,778.60	4.53
5	603278	大业股份	884,200	5,490,882.00	4.42
6	01882	海天国际	269,000	5,450,342.42	4.39
7	688698	伟创电气	182,472	4,921,269.84	3.96
8	002444	巨星科技	186,700	4,611,490.00	3.71
9	603337	杰克股份	171,700	4,519,144.00	3.64
10	300161	华中数控	165,000	3,710,850.00	2.99

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	406,246.03	0.33
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
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	406,246.03	0.33

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	019709	23 国债 16	4,000	406,246.03	0.33

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。

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

注：本基金本报告期无股指期货投资。

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

注：本基金本报告期内无国债期货投资。

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库以外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	39,099.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	52,232.73
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,408,140.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,499,472.74

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

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

项目	平安先进制造主题股票发起 A	平安先进制造主题股票发起 C
报告期期初基金份额总额	13,091,922.51	107,786,617.88
报告期期间基金总申购份额	1,331,995.30	117,566,179.87
减：报告期期间基金总赎回份额	1,537,374.07	87,469,704.90
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	12,886,543.74	137,883,092.85

§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	平安先进制造主题股票发起 A	平安先进制造主题股票发起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,833.62	-
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	10,002,833.62	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	77.62	-

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	10,002,833.62	6.63	10,000,000.00	6.63	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	10,002,833.62	6.63	10,000,000.00	6.63	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

注：无。

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先进制造主题股票型发起式证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安先进制造主题股票型发起式证券投资基金基金合同
- (3) 平安先进制造主题股票型发起式证券投资基金托管协议
- (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

2024 年 7 月 19 日