

平安中证汽车零部件主题交易型开放式指 数证券投资基金发起式联接基金 2026 年第 2 季度报告

2026 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 07 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 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 2026 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接
基金主代码	022731
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 4 日
报告期末基金份额总额	11,795,139.15 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。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 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	中证汽车零部件主题指数收益率×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	中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 A	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 C	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 E
下属分级基金的交易代码	022731	022732	024542
报告期末下属分级基金的份额总额	10,259,751.08 份	1,212,261.28 份	323,126.79 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159306
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 4 月 29 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 5 月 14 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	中国工商银行股份有限公司

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。在正常情况下，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	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。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。如果标的指数成份股发生明显负面事件面临停牌或退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 在正常情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值小 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致基金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、跟踪误差的进一步扩大。 当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证汽车零部件主题指数收益率
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。

§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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）		
	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 A	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 C	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 E
1. 本期已实现收益	64,693.26	4,933.09	3,069.40
2. 本期利润	10,182.80	-34,682.73	8,823.99
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0010	-0.0324	0.0170
4. 期末基金资产净值	10,863,336.97	1,278,488.33	341,936.09
5. 期末基金份额净值	1.0588	1.0546	1.0582

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

平安中证汽车零部件主题 ETF 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	0.08%	1.66%	-0.57%	1.69%	0.65%	-0.03%
过去六个月	-12.73%	1.56%	-13.22%	1.59%	0.49%	-0.03%
过去一年	12.55%	1.49%	14.57%	1.53%	-2.02%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	5.88%	1.49%	9.12%	1.59%	-3.24%	-0.10%

平安中证汽车零部件主题 ETF 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	0.00%	1.66%	-0.57%	1.69%	0.57%	-0.03%
过去六个月	-12.86%	1.56%	-13.22%	1.59%	0.36%	-0.03%

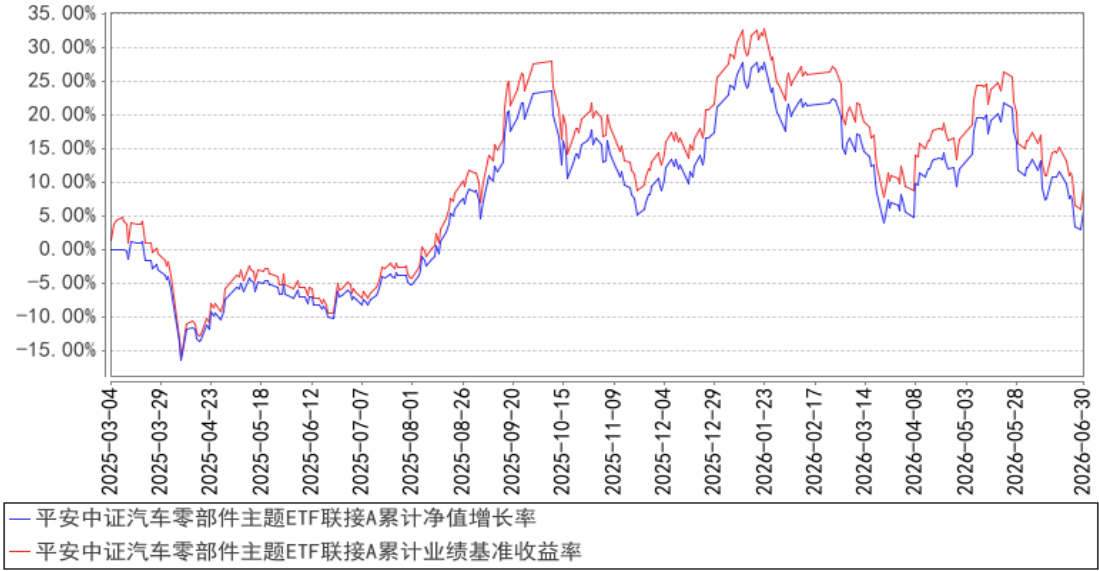
过去一年	12.20%	1.49%	14.57%	1.53%	-2.37%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	5.46%	1.49%	9.12%	1.59%	-3.66%	-0.10%

平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 E

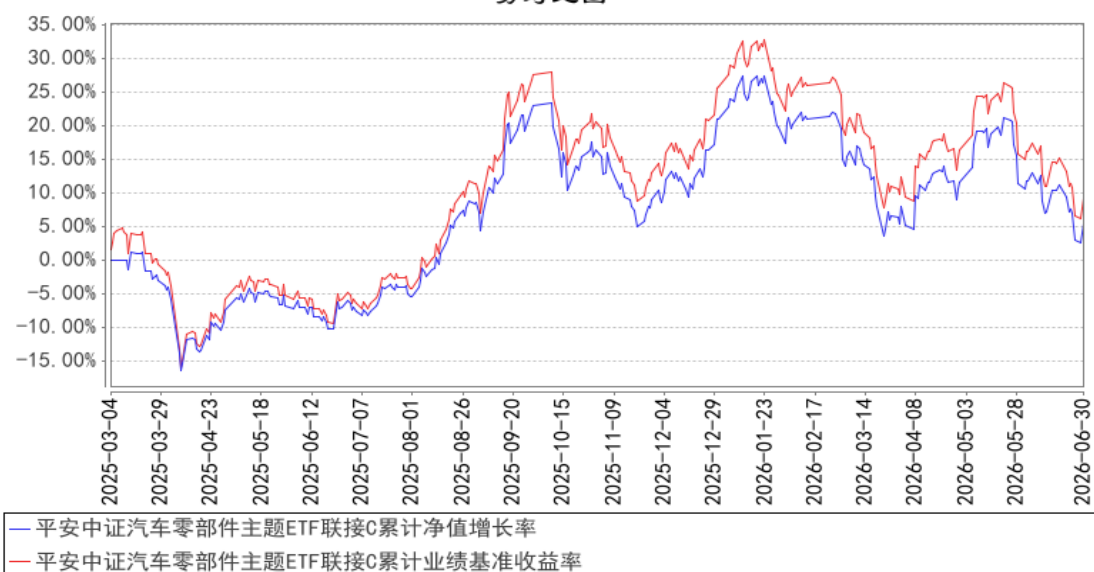
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.05%	1.66%	-0.57%	1.69%	0.62%	-0.03%
过去六个月	-12.77%	1.56%	-13.22%	1.59%	0.45%	-0.03%
过去一年	12.43%	1.49%	14.57%	1.53%	-2.14%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	13.87%	1.48%	16.06%	1.53%	-2.19%	-0.05%

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

平安中证汽车零部件主题ETF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



平安中证汽车零部件主题ETF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



平安中证汽车零部件主题ETF联接E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 2025 年 03 月 04 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、本基金于 2025 年 06 月 17 日增设 E 类份额，E 类份额从 2025 年 06 月 27 日开始有份额，所以上 E 类份额走势图从 2025 年 06 月 27 日开始。

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		
翁欣	平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理	2025 年 3 月 4 日	-	6 年	翁欣女士，哥伦比亚大学金融数学专业硕士，曾担任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部研究员。2023 年 5 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，现任平安中证港股通医药卫生综合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、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证畜牧养殖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、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证卫星产业指数型证券投资基金、平安恒生港股通中国央企红利交易型开放式指数证券投资基金、平安恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
马浩然	平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理	2025 年 10 月 20 日	-	5 年	马浩然先生，复旦大学金融学硕士，曾任海通证券股份有限公司零售分析师、东吴证券股份有限公司策略分析师、国泰海通证券股份有限公司资深策略分析师。2025 年 6 月加入平安基金管理有限公司，现担任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、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、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、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金发起式

					联接基金、平安中证卫星产业指数型证券投资基金、平安中证通用航空主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题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《基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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汽车零部件主题 ETF 联接 A 的基金份额净值 1.0588 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准收益率为-0.57%；截至本报告期末平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 C 的基金份额净值 1.0546 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为-0.57%；截至本报告期末平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 E 的基金份额净值 1.0582 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.05%，同期业绩比较基准收益率为-0.57%。

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	11,840,126.87	93.77
3	固定收益投资	100,648.19	0.80
	其中：债券	100,648.19	0.80
	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	649,979.77	5.15
8	其他资产	35,459.20	0.28
9	合计	12,626,214.03	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境内股票。

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

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	100,648.19	0.81
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	100,648.19	0.81

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	019827	26 国债 01	1,000	100,648.19	0.81

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。

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	平安中证汽车零部件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	平安基金管理有限公司	11,840,126.87	94.84

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约定的备选股票库

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	1,080.04
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	34,379.16
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	35,459.20

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	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 A	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 C	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 E
报告期期初基金份额总额	10,413,701.63	1,067,005.68	612,486.62
报告期期间基金总申购份额	201,351.16	2,181,326.00	728,333.42
减：报告期期间基金总赎回份额	355,301.71	2,036,070.40	1,017,693.25
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	10,259,751.08	1,212,261.28	323,126.79

§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	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 A	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 C	平安中证汽车零部件主题 ETF 联接 E
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,083.54	-	-
报告期期间买入/申购总份额	0.00	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,002,083.54	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	97.49	-	-

注：1、申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

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	发起份额总数	发起份额占基金总	发起份额承
----	--------	----------	--------	----------	-------

		份额比例(%)		份额比例(%)	诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,083.54	84.80	10,000,000.00	84.78	三年
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	10,002,083.54	84.80	10,000,000.00	84.78	三年

§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	2026/04/01-2026/06/30	10,002,083.54	0.00	0.00	10,002,083.54	84.80
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汽车零部件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) 平安中证汽车零部件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) 平安中证汽车零部件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

2026 年 07 月 21 日