

财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年3月1日（基金合同生效日）起至2023年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 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	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8 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贵金属投资明细	60
7.9 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	60

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	63
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
11.1 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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录.....	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	财通碳中和一年持有期混合	
场内简称	-	
基金主代码	008576	
交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年03月01日	
基金管理人	财通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	551,914,675.85份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通碳中和一年持有期混合A	财通碳中和一年持有期混合C
下属分级基金场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	008576	008577
报告期末下属分级基金的份额总额	537,145,741.12份	14,768,934.73份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于碳中和主题相关公司,在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将及时跟踪市场环境变化,根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,综合评价各类资产的风险收益水平,制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、碳中和主题相关证券的界定</p> <p>据联合国政府间气候变化专门委员会 (IPCC)</p>

特别报告《全球变暖1.5°C》，碳中和（carbon neutrality）是指在一定时间内，人为产生的二氧化碳的排放量与二氧化碳去除量相平衡，实现二氧化碳“净零排放”。在第七十五届联合国大会一般性辩论上，我国确立了“二氧化碳排放力争于2030年前达到峰值，努力争取2060年前实现碳中和”的长期目标。要实现碳中和，能源活动领域的零碳燃料替代是核心内容，同时要加快交通运输、制造业和建筑业的脱碳过程。

本基金投资标的将围绕碳中和目标下减碳路径所涉及的相关产业链和行业。从碳排放源出发，中国碳中和的减碳路径主要是电力行业脱碳化、工业行业节能化、交运行业电力化、建筑行业绿色化。具体的减碳路径、对应产业链如下：

（1）电力行业：风电、光伏和储能行业的下游运营商、中游制造环节设备组件和材料及上游的资源品；转型绿色电力的火电、核电运营商及其上游设备；特高压及智慧电网的设备和材料。

（2）工业行业：对应节能减排产业链。指在工业生产环节中，通过技术升级与工艺改造减少碳排放量，涉及钢铁、化工和机械设备行业。其中：钢铁行业主要关注绿色生产工艺改造，包括特种钢铁、电炉炼钢和氢能炼钢，实现钢铁生产脱碳；化工行业主要关注研发化工新材料和新技术，实现非化石能源对传统能源的替代，促进节能减排；机械设备行业主要关注两方面，一是新能源设备，主要满足下游新能源装机量需求，包括光伏设备、锂电设备、风电设备、天然气设备及其核心零部件企业；二是新设备替代传统机械设备的转型，包括节油发动机和自动化设备。

（3）交通行业：对应新能源车产业链。既包括新能源整车及其核心零部件，也包括动力电池及材料、空调系统、绿色轮胎和车身轻量化材料。其中动力电池及材料指上游锂矿、磷矿、萤石矿和硅料，中游的正负极材料、电解液、导电添加剂、隔

膜及封装材料，下游的电池组装及电池生产过程中用到的其他材料。

（4）建筑行业：对应绿色建筑产业链，包括环保建材、装配式建筑。

（5）公共行业：对应环保产业链。主要投资领域为环保装备和污染治理，包括废水、废气、处置设备与材料。

### 3、股票投资策略

本基金将综合分析行业的成长性和空间、景气度、估值水平等多个维度，实现投资组合在各行业之间的灵活、合理、高效配置。

在个股选择上，本基金依据碳中和主题相关公司所具备的特征，自下而上精选基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险，追求股票投资组合的长期稳定增值。

### 4、债券投资策略

本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测，确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。本基金注重组合的流动性，在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，自上而下确定大类债券资产配置和信用债券类属配置，动态调整组合久期和信用债券的结构，依然坚持自下而上精选个券的策略，在获取持有期收益的基础上，优化组合的流动性。

### 5、股指期货的交易策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货交易时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的

	<p>估值水平。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值。</p>	
业绩比较基准	<p>中证内地低碳经济主题指数收益率×55%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×25%</p>	
风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。本基金可以投资港股通标的股票，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。</p>	
下属分级基金的风险收益特征	<p>本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。本基金可以投资港股通标的股票，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。</p>	<p>本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金。本基金可以投资港股通标的股票，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。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		财通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	方斌	郭明
	联系电话	021-20537888	010-66105799



人	电子邮箱	service@ctfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-9888	95588
传真		021-68888169	010-66105799
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		吴林惠	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ctfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年03月01日(基金合同生效日)-2023年06月30日)	
	财通碳中和一年持有期混合A	财通碳中和一年持有期混合C

本期已实现收益	-45,072,102.31	-1,275,295.75
本期利润	-47,103,259.25	-1,329,887.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0877	-0.0901
本期加权平均净值利润率	-8.91%	-9.17%
本期基金份额净值增长率	-8.77%	-9.01%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-47,119,375.16	-1,331,274.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0877	-0.0901
期末基金资产净值	490,026,365.96	13,437,660.46
期末基金份额净值	0.9123	0.9099
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-8.77%	-9.01%

注：(1)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；

(2)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；

(3)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

(4)本基金基金合同于2023年3月1日生效，无比较式的上年度数据。

### 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

财通碳中和一年持有期混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-7.11%	2.15%	2.77%	0.98%	-9.88%	1.17%
过去三个月	-11.23%	2.45%	-3.47%	0.96%	-7.76%	1.49%

自基金合同生效起至今	-8.77%	2.09%	-5.42%	0.90%	-3.35%	1.19%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

### 财通碳中和一年持有期混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-7.16%	2.15%	2.77%	0.98%	-9.93%	1.17%
过去三个月	-11.41%	2.45%	-3.47%	0.96%	-7.94%	1.49%
自基金合同生效起至今	-9.01%	2.09%	-5.42%	0.90%	-3.59%	1.19%

注：(1)上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；

(2)本基金业绩比较基准为：中证内地低碳经济主题指数收益率\*55%+中债综合指数收益率\*25%+恒生指数收益率\*20%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

财通碳中和一年持有期混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



财通碳中和一年持有期混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年03月01日-2023年06月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2023年3月1日，基金合同生效起至报告期末不满一年；  
(2)本基金建仓期是合同生效日起6个月，截至本报告期末，本基金仍处于建仓期，基金的资产配置将在建仓期结束后符合基金契约的相关要求。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通基金管理有限公司成立于2011年6月，由财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江瀚叶股份有限公司共同发起设立，财通证券股份有限公司为第一大股东，出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币，注册地上海，经营范围为基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

财通基金始终秉承“持有人利益至上”的核心价值观，致力于为客户提供专业优质的资产管理服务。在公募业务方面，公司坚持以客户利益为出发点设计产品，逐步建立起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线，获得一定市场口碑；公司将特定客户资产管理业务作为重要发展战略之一，形成玉泉系列、富春系列等多个子品牌，产品具有追求绝对收益、标的丰富、方案灵活等特点，为机构客户、高端个人客户提供个性化的理财选择。

截至2023年6月30日，公司员工共计228人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在13年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务，财通基金始终与持有

人保持信息透明；通过建立完备的风险控制体系，财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金梓才	公司总经理助理、权益投资总监、基金投资部总经理、本基金的基金经理	2023-03-01	-	13年	上海交通大学微电子学硕士。历任华泰资产管理有限公司投资经理助理，信诚基金管理有限公司TMT行业高级研究员。2014年8月加入财通基金管理有限公司，曾任基金投资部基金经理、副总监、副总监（主持工作）、总监，现任公司总经理助理、权益投资总监、基金投资部总经理、基金经理。

注：(1)基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定；

(4)基金管理人于2023年7月3日增聘唐家伟先生担任本基金的基金经理。

#### 4.1.3 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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律、法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

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《财通基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本投资组合为主动型基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度宏观经济复苏不及预期，居民消费意愿依旧较弱。出口、地产、消费的复苏边际放缓。五一出行客流虽大，但客单价低，侧面反应居民消费意愿不强，储蓄意愿较高。核心CPI同比增速仍比较温和，M2增长相对稳定。我们认为CPI下探主要是由于食品和能源分项的高基数导致，也是经济“分化式复苏”的结果，并不代表系统性风险，经济仍处于弱复苏的过程中。周期制造业景气回升弹性较小，需要再观察投资机会。本基金遵循符合碳中和发展理念的高景气行业的中观配置思路，当前重点配置以下行业：

1) 火电盈利改善，新能源组件降价。中期来看，伴随动力煤产能在政策推动下持续释放，未来两年供给有望边际宽松，价格有望下行。火电企业的长协煤履约率有望继续提升，成本持续下降，盈利底已经逐步显现。当前煤炭进口政策已经全面放开，煤炭价格加速下行，硅料价格供需矛盾缓解，价格也不断下行，火电成本持续改善，我们的逻辑在不断验证。当前硅料价格已经下跌，且下游组件行业竞争激烈化，一体化组件厂具有一定的成本优势，引领组件价格下降，或将利好下游运营商。未来火电企业作为绿电运营商，开工意愿恢复，投资回报率提升，装机量和盈利能力有望双重改善。火电公司迎来价值重估，业绩持续改善，伴随新能源大规模并网，电力系统调峰负担加大，火电调峰储能消纳功能逐步凸显，“十四五”期间绿电装机大幅增长，火电企业占比近半，叠加电价市场化改革、绿电交易推广等预期，火电企业有望迎来向上戴维斯双击。

2) 氟化工投资逻辑是：三代制冷剂配额落定，未来供需改善带来景气反转。2016年在《蒙特利尔协议书》缔约方达成协议，对三代制冷剂实行限控。中国选取2020-2022年三年为配额考核期，这三年的平均产量将作为给企业配额的依据。因此过去三年供给过剩，主流产品R32、R134a等价格跌入谷底。2023年以后配额确认，行业产量或收缩，叠加需求见底，未来行业景气会逐渐上升，价格有望见底回升。龙头企业对价格掌控力强，三代制冷剂目前行业集中度高达70%左右，未来龙头企业控量保价意愿强烈背景下，产品价格或给上市公司带来业绩弹性。

3) 新能源汽车需求量依然稳健，零部件行业景气较好。国内需求方面，价格战影响减弱、库存逐步消化，2023年下半年国内需求有望持续回暖。出口需求方面，2023年中国车企依靠新能源技术实现产品力提升，进入欧美发达国家市场，并在传统市场实现市占率提升。零部件方面，我们比较看好大客户深度绑定，智能化水平高，市占率提升，业绩兑现性较强的标的。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通碳中和一年持有期混合A基金份额净值为0.9123元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.77%，同期业绩比较基准收益率为-5.42%；截至报告

期末，财通碳中和一年持有期混合C基金份额净值为0.9099元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.01%，同期业绩比较基准收益率为-5.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，国际局势仍不稳定，宏观变量依旧错综复杂，新科技新技术方兴未艾，我们会对不同的宏观背景做敏感性分析，相机抉择，及时对组合做出优化配置。我们倾向于认为，去年疫情的阶段性冲击后，国内经济同比增速的绝对低点已经过去，但由于企业和居民的长期收入预期下降，社会有效需求不足，复苏低于预期，后续宏观经济整体仍然是一波三折的弱复苏为主。而这种宏观背景下，周期制造业本身投资机会不大，况且本基金所配置行业范围限定在碳中和相关，因此更需要精挑细选，精选细分赛道的阿尔法，当前所选择的火电、氟化工、轮胎和新材料行业，我们会继续持有。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票指数的通知》《关于固定收益品种的估值处理标准》《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》和《资产管理产品相关会计处理规定》等法律法规、自律规则等设立公司估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会成员由总经理、督察长、投研部门分管领导、基金清算部门分管领导、基金投资部、专户投资部、固收投资部、量化投资部、研究部、风险管理部、法律合规部、基金清算部等部门负责人、基金清算部相关业务人员、涉及的相关基金经理或投资经理或实际履行前述部门相当职责的部门负责人或人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。如果基金经理认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序、确定调整/暂停估值方案，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》，与中国工商银行股份有限公司上海市分行于2018年6月签订了《基金行政外包协议》，与中信中证投资服务有限责任公司于2019年7月签订了《行政管理服务协议》，与申万宏源证券有限公司于2019年9月签订了《运营服务合同》、于2020年5月签订了《基金运营服务合同》。截至报告期末，基金管理人对旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行外包。



#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

根据相关法律法规及《基金合同》的要求，结合本基金运作情况，本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人--财通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对财通基金管理有限公司编制和披露的本基金2023年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末
----	-----	-----

		2023年06月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	119,384,745.99
结算备付金		2,273,381.01
存出保证金		257,968.47
交易性金融资产	6.4.7.2	464,257,046.77
其中：股票投资		464,257,046.77
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		2,035,858.95
应收股利		-
应收申购款		5,170.11
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		588,214,171.30
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-

衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		82,317,077.23
应付赎回款		-
应付管理人报酬		655,744.38
应付托管费		109,290.73
应付销售服务费		9,336.95
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	1,658,695.59
负债合计		84,750,144.88
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	551,914,675.85
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-48,450,649.43
净资产合计		503,464,026.42
负债和净资产总计		588,214,171.30

注：(1)报告截止日2023年06月30日，基金份额总额551,914,675.85份。其中A类基金份额净值0.9123元，份额总额537,145,741.12份；C类基金份额净值0.9099元，份额总额14,768,934.73份。

(2)本基金基金合同于2023年3月1日生效，无比较式的上年度数据。

## 6.2 利润表

会计主体：财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年03月01日（基金合同 生效日）至2023年06月30 日

<b>一、营业总收入</b>		-45,172,381.17
1.利息收入		287,763.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	211,309.49
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		76,454.43
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-43,374,396.48
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-45,529,095.84
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	2,154,699.36
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-2,085,748.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,260,765.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,703,727.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	450,621.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	38,516.16
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-

7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.17	67,900.32
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-48,433,146.67
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-48,433,146.67
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-48,433,146.67

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年03月01日(基金合同生效日)至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月01日(基金合同生效日)至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	551,677,369.45	-	-	551,677,369.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	237,306.40	-	-48,450,649.43	-48,213,343.03
(一)、综合收益总额	-	-	-48,433,146.67	-48,433,146.67
(二)、本期基	237,306.40	-	-17,502.76	219,803.64

金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1.基金申购款	237,306.40	-	-17,502.76	219,803.64
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	551,914,675.85	-	-48,450,649.43	503,464,026.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

徐春庭

刘为臻

刘为臻

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),先经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2426号《关于准予财通中证中高等级信用债指数证券投资基金注册的批复》的核准,后经中国证监会证监许可[2022]173号《关于准予财通中证中高等级信用债指数证券投资基金变更注册的批复》变更注册,由基金管理人财通基金管理有限公司自2023年2月6日至2023年2月24日止期间向社会公开发行募集,募集期结束经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出

具毕马威华振验字第2300386号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2023年3月1日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币551,456,282.41元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币221,087.04元，以上收到的实收基金（本息）共计人民币551,677,369.45元，折合基金份额551,677,369.45份，其中A类基金份额536,925,917.57份，C类基金份额14,751,451.88份。本基金的基金管理人和注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（含国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%）；投资于碳中和主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证内地低碳经济主题指数收益率×55%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×25%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报

表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及自2023年3月1日（基金合同生效日）起至2023年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2023年3月1日（基金合同生效日）起至2023年6月30日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；



对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对A类和C类基金份额选择不同的分红方式；同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则基金份额登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准；对于收益分配方式为红利再投资的基金份额，每份基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期限，按该原份额的持有期限计算。

(3)基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4)由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。

(5)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上

基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
----	--------------------

活期存款	119,384,745.99
等于：本金	119,380,744.95
加：应计利息	4,001.04
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	119,384,745.99

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	466,342,795.38	-	464,257,046.77	-2,085,748.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-



合计	466,342,795.38	-	464,257,046.77	-2,085,748.61
----	----------------	---	----------------	---------------

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,590,917.27
其中：交易所市场	1,590,917.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	67,778.32
合计	1,658,695.59

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 财通碳中和一年持有期混合A

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(财通碳中和一年持有期混合 A)	2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	536,925,917.57	536,925,917.57
本期申购	219,823.55	219,823.55
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	537,145,741.12	537,145,741.12

#### 6.4.7.7.2 财通碳中和一年持有期混合C

金额单位：人民币元

项目 (财通碳中和一年持有期混合 C)	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	14,751,451.88	14,751,451.88
本期申购	17,482.85	17,482.85
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	14,768,934.73	14,768,934.73

注：(1)申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额；

(2)本基金基金合同生效日为2023年3月1日。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币551,456,282.41元，在募集期间产生的存款利息为人民币221,087.04元，以上实收基金（本息）合计为人民币551,677,369.45元，折合551,677,369.45份基金份额，其中A类基金份额536,925,917.57份，C类基金份额14,751,451.88份。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 财通碳中和一年持有期混合A

单位：人民币元

项目 (财通碳中和一年持有 期混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-45,072,102.31	-2,031,156.94	-47,103,259.25

本期基金份额交易产生的变动数	-20,318.53	4,202.62	-16,115.91
其中：基金申购款	-20,318.53	4,202.62	-16,115.91
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-45,092,420.84	-2,026,954.32	-47,119,375.16

#### 6.4.7.8.2 财通碳中和一年持有期混合C

单位：人民币元

项目 (财通碳中和一年持有期混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,275,295.75	-54,591.67	-1,329,887.42
本期基金份额交易产生的变动数	-1,675.10	288.25	-1,386.85
其中：基金申购款	-1,675.10	288.25	-1,386.85
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,276,970.85	-54,303.42	-1,331,274.27

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日
活期存款利息收入	197,802.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,866.95
其他	639.60
合计	211,309.49

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日
卖出股票成交总额	1,096,103,160.99
减：卖出股票成本总额	1,138,205,210.91
减：交易费用	3,427,045.92
买卖股票差价收入	-45,529,095.84

### 6.4.7.11 债券投资收益

#### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--买卖债券差价收入

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--赎回差价收入。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

### 6.4.7.12 衍生工具收益

#### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,154,699.36
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,154,699.36

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-2,085,748.61
——股票投资	-2,085,748.61
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,085,748.61

#### 6.4.7.15 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日
审计费用	27,908.72
信息披露费	39,869.60
证券出借违约金	-
汇划手续费	122.00
合计	67,900.32

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
财通基金管理有限公司("财通基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
财通证券股份有限公司("财通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券	388,921,087.88	14.43%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
财通证券	165,417,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	360,520.93	17.02%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	当期发生的基金应支付的管理费	2,703,727.76
其中：支付销售机构的客户维护费	1,251,198.12	

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2)基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数；

(3)客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	450,621.26

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通碳中和一年持有期混合 A	财通碳中和一年持有期混合 C	合计
财通证券	0.00	21,785.46	21,785.46



财通基金	0.00	28.65	28.65
中国工商银行	0.00	3,609.04	3,609.04
合计	0.00	25,423.15	25,423.15

注：(1)本基金A类基金份额不收取销售服务费；

(2)本基金C类基金份额基金销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.8%年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；

(3)本基金C类基金份额销售服务费计提的计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.8%÷当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况  
无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况  
无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年03月01日（基金合同生效日）至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商	119,384,745.99	197,802.94

银行		
----	--	--

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期无其他当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内（含）	认购新发证券	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内（含）	认购新发证券	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内（含）	认购新发证券	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内（含）	认购新发	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-

				证券						
3012 61	恒工 精密	2023 -06-2 9	1个月内 (含)	认购 新发 证券	36.90	36.90	1,775	65,49 7.50	65,49 7.50	-
6882 49	晶合 集成	2023 -04-2 4	6个月	新股 限售	19.86	18.06	2,468	49,01 4.48	44,57 2.08	-
6883 61	中科 飞测	2023 -05-1 2	6个月	新股 限售	23.60	64.67	499	11,77 6.40	32,27 0.33	-
6884 69	中芯 集成	2023 -04-2 8	6个月	新股 限售	5.69	5.41	4,830	27,48 2.70	26,13 0.30	-
6884 43	智翔 金泰	2023 -06-1 3	6个月	新股 限售	37.88	29.49	867	32,84 1.96	25,56 7.83	-
3012 93	三博 脑科	2023 -04-2 5	6个月	新股 限售	29.60	71.42	333	9,85 6.80	23,78 2.86	-
6884 72	阿特 斯	2023 -06-0 2	6个月	新股 限售	11.10	17.04	1,392	15,45 1.20	23,71 9.68	-
6885 82	芯动 联科	2023 -06-2 1	6个月	新股 限售	26.74	40.68	580	15,50 9.20	23,59 4.40	-
3013 25	曼恩 斯特	2023 -05-0 4	6个月	新股 限售	76.80	107.9 5	182	13,97 7.60	19,64 6.90	-
6885 76	西山 科技	2023 -05-3 0	6个月	新股 限售	135.8 0	120.4 1	143	19,41 9.40	17,21 8.63	-
6885 81	安杰 思	2023 -05-1 2	6个月	新股 限售	125.8 0	118.0 3	142	17,86 3.60	16,76 0.26	-
6885 52	航天 南湖	2023 -05-0 8	6个月	新股 限售	21.17	23.50	683	14,45 9.11	16,05 0.50	-

301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股限售	38.13	31.03	498	18,988.74	15,452.94	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股限售	14.81	13.73	1,111	16,453.91	15,254.03	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	新股限售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	新股限售	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	新股限售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	新股限售	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688620	安凯微	2023-06-15	6个月	新股限售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股限售	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
6885	天玛	2023	6个月	新股	30.26	25.33	385	11,65	9,75	-

70	智控	-05-29		限售				0.10	2.05	
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	新股限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	新股限售	43.67	53.05	171	7,467.57	9,071.55	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股限售	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股限售	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股限售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股限售	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股限售	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。公司经营管理层负责公司日常经营管理中的风险控制工作，经营管理层下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的法律合规部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时

变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	119,384,745.99	-	-	-	-	-	119,384,745.99
结算备付金	2,273,381.01	-	-	-	-	-	2,273,381.01
存出保证金	257,968.47	-	-	-	-	-	257,968.47
交易性金融资产	-	-	-	-	-	464,257,046.77	464,257,046.77
应收	-	-	-	-	-	2,035,858.95	2,035,858.95



清算款							
应收申购款	-	-	-	-	-	5,170.11	5,170.11
资产总计	121,916,095.47	-	-	-	-	466,298,075.83	588,214,171.30
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	82,317,077.23	82,317,077.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	655,744.38	655,744.38
应付托管费	-	-	-	-	-	109,290.73	109,290.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,336.95	9,336.95
其他负债	-	-	-	-	-	1,658,695.59	1,658,695.59
负债总计	-	-	-	-	-	84,750,144.88	84,750,144.88
利率敏感度缺口	121,916,095.47	-	-	-	-	381,547,930.95	503,464,026.42

注：表中所示为本基金资产负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末和上期末均未持有交易性固定收益类投资（不含可转换债券及可交换债券），且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%）；投资于碳中和主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	464,257,046.77	92.21
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属	-	-

投资		
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	464,257,046.77	92.21

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。	
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。	
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023年06月30日
	业绩比较基准增加1%	-2,140,084.13
	业绩比较基准减少1%	2,140,084.13

注：本基金于2023年3月1日成立，无比较式的上年度数据。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日
第一层次	463,316,725.90
第二层次	423,888.14

第三层次	516,432.73
合计	464,257,046.77

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2、其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	464,257,046.77	78.93
	其中：股票	464,257,046.77	78.93
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	121,658,127.00	20.68
8	其他各项资产	2,298,997.53	0.39
9	合计	588,214,171.30	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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	171,746,468.69	34.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	201,795,575.18	40.08
E	建筑业	14,811,580.00	2.94
F	批发和零售业	9,454.20	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	41,153,729.96	8.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,956,743.00	3.57
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	16,745,318.40	3.33

S	综合	-	-
	合计	464,257,046.77	92.21

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	300037	新宙邦	585,700	30,391,973.00	6.04
2	600011	华能国际	3,221,300	29,829,238.00	5.92
3	603305	旭升集团	1,023,400	28,522,158.00	5.67
4	603179	新泉股份	649,100	28,488,999.00	5.66
5	300750	宁德时代	123,460	28,246,413.40	5.61
6	002608	江苏国信	3,414,444	25,847,341.08	5.13
7	600933	爱柯迪	1,091,800	25,428,022.00	5.05
8	600027	华电国际	3,785,900	25,327,671.00	5.03
9	000543	皖能电力	3,749,789	24,748,607.40	4.92
10	600021	上海电力	2,281,400	24,570,678.00	4.88
11	601991	大唐发电	7,398,600	24,489,366.00	4.86
12	000539	粤电力 A	3,334,489	24,341,769.70	4.83
13	000690	宝新能源	3,225,200	22,640,904.00	4.50
14	688095	福昕软件	150,078	18,966,857.64	3.77
15	300280	紫天科技	375,900	17,956,743.00	3.57
16	300654	世纪天鸿	1,276,320	16,745,318.40	3.33
17	300559	佳发教育	979,400	16,160,100.00	3.21
18	000977	浪潮信息	330,300	16,019,550.00	3.18
19	000032	深桑达 A	450,200	14,811,580.00	2.94
20	688501	青达环保	600,000	13,350,000.00	2.65

21	002605	姚记科技	68,700	3,189,741.00	0.63
22	002558	巨人网络	150,400	2,696,672.00	0.54
23	301291	明阳电气	4,976	161,435.74	0.03
24	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.03
25	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.03
26	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.02
27	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
28	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.02
29	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.02
30	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
31	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
32	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
33	688249	晶合集成	2,468	44,572.08	0.01
34	688361	中科飞测	499	32,270.33	0.01
35	688469	中芯集成	4,830	26,130.30	0.01
36	688443	智翔金泰	867	25,567.83	0.01
37	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
38	688472	阿特斯	1,392	23,719.68	0.00
39	688582	芯动联科	580	23,594.40	0.00
40	301325	曼恩斯特	182	19,646.90	0.00
41	688576	西山科技	143	17,218.63	0.00
42	688581	安杰思	142	16,760.26	0.00
43	688552	航天南湖	683	16,050.50	0.00
44	301332	德尔玛	1,111	15,254.03	0.00
45	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
46	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
47	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
48	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
49	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
50	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
51	688570	天玛智控	385	9,752.05	0.00

52	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
53	688543	国科军工	171	9,071.55	0.00
54	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
55	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
56	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
57	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600011	华能国际	62,710,144.82	12.46
2	603179	新泉股份	61,109,673.99	12.14
3	300750	宁德时代	60,690,710.40	12.05
4	000539	粤电力A	57,661,973.06	11.45
5	603305	旭升集团	55,984,970.16	11.12
6	601991	大唐发电	53,795,645.98	10.69
7	600027	华电国际	52,062,467.00	10.34
8	600933	爱柯迪	42,449,615.01	8.43
9	688095	福昕软件	33,286,053.24	6.61
10	300223	北京君正	30,743,763.03	6.11
11	300037	新宙邦	30,382,301.75	6.03
12	603986	兆易创新	30,094,236.49	5.98
13	300002	神州泰岳	29,834,242.62	5.93
14	002919	名臣健康	28,422,448.90	5.65
15	000021	深科技	27,918,981.56	5.55
16	300559	佳发教育	27,850,848.52	5.53
17	603533	掌阅科技	26,186,628.81	5.20
18	600021	上海电力	25,907,817.00	5.15
19	000543	皖能电力	25,760,458.05	5.12



20	002608	江苏国信	25,506,749.08	5.07
21	300059	东方财富	24,900,341.64	4.95
22	300299	富春股份	24,020,203.00	4.77
23	601595	上海电影	23,722,260.20	4.71
24	600373	中文传媒	22,958,837.00	4.56
25	300654	世纪天鸿	22,847,318.90	4.54
26	000690	宝新能源	22,693,276.82	4.51
27	002315	焦点科技	22,496,717.60	4.47
28	300036	超图软件	22,475,512.51	4.46
29	300474	景嘉微	22,406,352.00	4.45
30	600667	太极实业	22,364,413.00	4.44
31	688475	萤石网络	22,315,396.26	4.43
32	688256	寒武纪	22,100,925.98	4.39
33	688111	金山办公	22,057,488.53	4.38
34	300364	中文在线	21,954,998.76	4.36
35	002517	恺英网络	21,938,350.26	4.36
36	688088	虹软科技	21,505,791.02	4.27
37	300280	紫天科技	21,254,373.00	4.22
38	002558	巨人网络	21,090,180.56	4.19
39	300418	昆仑万维	20,824,020.60	4.14
40	601900	南方传媒	20,051,052.99	3.98
41	601928	凤凰传媒	19,813,125.00	3.94
42	000977	浪潮信息	19,405,588.00	3.85
43	688590	新致软件	19,227,804.09	3.82
44	002624	完美世界	18,801,815.00	3.73
45	300548	博创科技	18,272,190.80	3.63
46	002291	遥望科技	17,074,092.00	3.39
47	301060	兰卫医学	17,014,493.00	3.38
48	300288	朗玛信息	16,617,768.61	3.30
49	002709	天赐材料	16,573,532.00	3.29
50	601689	拓普集团	16,565,693.90	3.29

51	300624	万兴科技	16,467,072.00	3.27
52	002343	慈文传媒	16,298,749.20	3.24
53	603258	电魂网络	16,274,354.13	3.23
54	603186	华正新材	16,256,386.79	3.23
55	601921	浙版传媒	16,084,934.00	3.19
56	002605	姚记科技	16,075,838.00	3.19
57	600556	天下秀	15,954,557.00	3.17
58	300148	天舟文化	15,893,366.36	3.16
59	601360	三六零	15,768,786.93	3.13
60	000032	深桑达 A	14,831,478.00	2.95
61	688501	青达环保	13,314,682.05	2.64

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	34,256,905.00	6.80
2	000021	深科技	34,236,064.00	6.80
3	603179	新泉股份	33,810,669.06	6.72
4	600011	华能国际	31,258,319.00	6.21
5	000539	粤电力 A	30,540,475.00	6.07
6	601991	大唐发电	28,942,003.84	5.75
7	603533	掌阅科技	28,293,261.00	5.62
8	300624	万兴科技	28,274,815.96	5.62
9	601595	上海电影	28,267,652.80	5.61
10	603305	旭升集团	28,100,562.60	5.58
11	300002	神州泰岳	26,356,250.04	5.23
12	002919	名臣健康	26,274,028.30	5.22
13	688095	福昕软件	25,654,722.02	5.10
14	600027	华电国际	25,062,071.00	4.98

15	603986	兆易创新	24,583,608.33	4.88
16	300059	东方财富	24,167,048.80	4.80
17	300223	北京君正	23,108,590.44	4.59
18	688111	金山办公	22,936,002.25	4.56
19	300364	中文在线	22,700,102.00	4.51
20	688256	寒武纪	22,314,311.15	4.43
21	002315	焦点科技	21,102,305.20	4.19
22	688475	萤石网络	20,883,192.42	4.15
23	300418	昆仑万维	20,783,328.00	4.13
24	002517	恺英网络	20,539,784.39	4.08
25	688088	虹软科技	20,522,914.67	4.08
26	600373	中文传媒	19,828,523.00	3.94
27	601900	南方传媒	19,745,961.06	3.92
28	600667	太极实业	19,363,159.93	3.85
29	603258	电魂网络	19,218,720.00	3.82
30	300036	超图软件	18,918,216.00	3.76
31	688590	新致软件	18,515,156.44	3.68
32	002558	巨人网络	18,430,545.00	3.66
33	002624	完美世界	17,694,970.12	3.51
34	300474	景嘉微	17,154,477.50	3.41
35	300288	朗玛信息	17,149,106.00	3.41
36	601360	三六零	16,930,401.00	3.36
37	601928	凤凰传媒	16,916,276.00	3.36
38	601689	拓普集团	16,484,739.07	3.27
39	002709	天赐材料	16,401,322.24	3.26
40	600933	爱柯迪	16,241,265.86	3.23
41	002343	慈文传媒	15,908,185.00	3.16
42	300299	富春股份	15,749,825.00	3.13
43	601921	浙版传媒	15,298,682.00	3.04
44	002291	遥望科技	14,561,416.00	2.89
45	002605	姚记科技	14,469,054.00	2.87

46	300548	博创科技	14,225,501.00	2.83
47	300148	天舟文化	12,984,978.00	2.58
48	600556	天下秀	12,716,079.00	2.53
49	301060	兰卫医学	11,688,987.00	2.32
50	603186	华正新材	11,520,977.00	2.29
51	300654	世纪天鸿	10,205,790.90	2.03

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,604,548,006.29
卖出股票收入（成交）总额	1,096,103,160.99

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货交易时，

将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金不投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本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收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	257,968.47
2	应收清算款	2,035,858.95
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,170.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,298,997.53

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
财通碳中和一年持有期混合A	3,770	142,478.98	820,261.30	0.1527%	536,325,479.82	99.8473%
财通碳中和一年持有期混合C	915	16,140.91	1,000,000.00	6.7710%	13,768,934.73	93.2290%
合计	4,685	117,804.63	1,820,261.30	0.3298%	550,094,414.55	99.6702%

注：基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数	占基金总份额
----	------	--------	--------

		(份)	比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	财通碳中和一年持有期混合A	8,006.08	0.0015%
	财通碳中和一年持有期混合C	12,000.72	0.0813%
	合计	20,006.80	0.0036%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	财通碳中和一年持有期混合A	0
	财通碳中和一年持有期混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	财通碳中和一年持有期混合A	0
	财通碳中和一年持有期混合C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通碳中和一年持有期混合A	财通碳中和一年持有期混合C
基金合同生效日(2023年03月01日)基金份额总额	536,925,917.57	14,751,451.88
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	219,823.55	17,482.85

减：基金合同生效日起至报告期 期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末 基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	537,145,741.12	14,768,934.73

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，本基金管理人于2023年6月1日聘任吴明建先生担任公司副总经理职务，吴明建先生现任公司副总经理、财务负责人职务。

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况



金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	196,456,576.22	7.29%	141,705.64	6.69%	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	388,921,087.88	14.43%	360,520.93	17.02%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	108,811,131.73	4.04%	79,572.27	3.76%	-
第一创业证券	2	40,691,783.70	1.51%	29,351.06	1.39%	-
东北证券	2	163,441,580.30	6.06%	118,022.00	5.57%	-
东方财富证券股份有限公司	2	127,753,534.07	4.74%	93,428.03	4.41%	-
东方证券	2	71,228,879.83	2.64%	52,090.64	2.46%	-

东海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	115,709,445.07	4.29%	83,461.30	3.94%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	100,580,532.56	3.73%	73,552.99	3.47%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	176,898,444.86	6.56%	163,135.46	7.70%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	165,111,970.62	6.12%	119,095.18	5.62%	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	403,149,766.81	14.95%	294,382.55	13.89%	-

民族证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	16,826,593.36	0.62%	15,669.84	0.74%	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	81,921,399.30	3.04%	75,474.16	3.56%	-
西部证券	2	27,188,291.13	1.01%	19,882.77	0.94%	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	7,090,546.00	0.26%	5,185.24	0.24%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	50,312,626.56	1.87%	36,290.79	1.71%	-
中国中投证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	155,402,980.97	5.76%	112,305.18	5.30%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
东兴	3	-	-	-	-	-

安信 证券	4	110,210,289.48	4.09%	79,876.31	3.77%	-
广发 证券	4	139,986,847.58	5.19%	130,372.75	6.15%	-
兴业 证券	4	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	4	48,348,400.50	1.79%	35,355.95	1.67%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-

新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	165,417,000.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2023-01-31
2	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2023-01-31
3	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2023-01-31
4	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2023-01-31
5	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023-01-31
6	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金风险揭示书	中国证监会规定媒介	2023-01-31
7	财通基金管理有限公司关于财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金拟参与科创板投资及相关风险揭示的公	中国证监会规定媒介	2023-01-31

	告		
8	财通基金管理有限公司分支机构负责人任职公告	中国证监会规定媒介	2023-02-04
9	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2023-03-02
10	关于上海爱建基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-22
11	财通基金管理有限公司关于设立浙江分公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-06
12	财通基金管理有限公司关于成都分公司经营范围变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-27
13	财通基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-05
14	关于财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-17
15	关于江西正融基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2023-05-20
16	财通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-06-02
17	财通基金管理有限公司关于旗下基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-06-30
18	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金更新招募说	中国证监会规定媒介	2023-06-30

	说明书（2023年06月30日公告）		
19	财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新（2023年06月30日公告）	中国证监会规定媒介	2023-06-30

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金募集的文件；
- 2、财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金基金合同；
- 3、财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金托管协议；
- 4、财通碳中和一年持有期混合型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：www.ctfund.com

财通基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十日