

# 诺安低碳经济股票型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：诺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

送出日期：2023 年 08 月 31 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 08 月 30 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 01 月 01 日起至 2023 年 06 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	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
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	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	净资产（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	43
7.1	期末基金资产组合情况	43
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50

7.12	投资组合报告附注 .....	50
§ 8	基金份额持有人信息 .....	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
§ 9	开放式基金份额变动 .....	53
§ 10	重大事件揭示 .....	53
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4	基金投资策略的改变 .....	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8	其他重大事件 .....	56
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
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 .....	58
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
§ 12	备查文件目录 .....	59
12.1	备查文件目录 .....	59
12.2	存放地点 .....	59
12.3	查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	诺安低碳经济股票型证券投资基金	
基金简称	诺安低碳经济股票	
基金主代码	001208	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 05 月 12 日	
基金管理人	诺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	
报告期末基金份额总额	394,958,701.59 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	诺安低碳经济股票 A	诺安低碳经济股票 C
下属分级基金的交易代码	001208	010349
报告期末下属分级基金的份额总额	274,917,914.51 份	120,040,787.08 份

注：自 2020 年 10 月 28 日起，本基金增加基金份额类别，分设 A 类基金份额和 C 类基金份额。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于低碳经济主题相关上市公司，在控制投资风险的同时，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、低碳经济主题配置策略</p> <p>a) 低碳经济主题及其相关行业和公司的界定</p> <p>走向低碳化时代是大势所趋，低碳经济也势在必行。低碳经济是一项系统工程，必须从经济和社会整体出发，着重在七个方面实现。低碳经济主题相关行业和公司来自于这七个方面：能源低碳化如以新能源、节能减排、绿色发展等为主营业务，提供相关设备、技术、产品、服务等与能源产业链相关的行业或公司，交通低碳化如新能源汽车等行业或公司，建筑低碳化如生产使用节能环保建筑材料的相关行业或公司，农业低碳化如林业、有机农业等行业或公司，工业低碳化如发展节能减排积极参与碳排放交易与治理的工业行业或公司，服务低碳化如提倡智能信息化服务的行业或公司，消费低碳化如提倡绿色消费及可循环消费的酒店、旅游等行业或公司。</p> <p>未来随着经济增长方式转变和产业结构升级，从事或受益于上述投</p>

	<p>资主题的外延将会逐渐扩大,本基金将视实际情况调整上述对低碳经济主题类股票的识别及认定。</p> <p>b) 行业配置策略</p> <p>本基金将分别从以下几个方面对低碳经济的各个子行业进行分析:</p> <p>(1) 政策分析: 本基金将密切关注低碳经济相关国家产业政策以及财政税收政策和货币政策等变化对低碳经济主题相关行业的影响, 积极配置收益于政策变化的行业。</p> <p>(2) 公司分析: 技术水平将影响低碳经济主题相关公司的发展情况。本基金将密切跟踪低碳经济主题相关公司技术水平变化及发展趋势, 重点关注技术水平提升较快且发展趋势良好的上市公司。</p> <p>(3) 市场分析: 低碳经济主题相关行业可能会处于各自不同的发展阶段及行业周期, 本基金将重点关注处于行业上升阶段及上升周期的子行业进行投资。</p> <p>3、个股投资策略方面, 本基金将结合定量与定性分析, 充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力, 选择具有领先优势、创新能力及成长潜力良好的上市公司进行投资。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据投资目标和股票投资策略, 基于对基础证券投资价值的研究判断, 进行存托凭证的投资。</p> <p>5、债券投资策略方面, 本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略, 具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。</p> <p>6、权证投资策略方面, 本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具, 我们将结合自身资产状况审慎投资, 力图获得最佳风险调整收益。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下, 通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响, 充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性, 谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资, 以降低流动性风险。</p> <p>未来, 根据市场情况, 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。</p>
业绩比较基准	80%×中证内地低碳经济主题指数收益率+20%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金, 属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种, 其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	郭明

	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		李强	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.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层

## § 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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日）	
	诺安低碳经济股票 A	诺安低碳经济股票 C
本期已实现收益	102,026,928.21	55,556,453.93
本期利润	86,028,223.79	44,604,724.48
加权平均基金份额本期利润	0.2081	0.2030
本期加权平均净值利润率	8.52%	8.36%
本期基金份额净值增长率	3.69%	3.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
	诺安低碳经济股票 A	诺安低碳经济股票 C
期末可供分配利润	381,626,991.75	164,429,032.26
期末可供分配基金份额利润	1.3881	1.3698
期末基金资产净值	656,544,906.26	284,469,819.34
期末基金份额净值	2.388	2.370
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
	诺安低碳经济股票 A	诺安低碳经济股票 C
基金份额累计净值增长率	138.80%	33.82%

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，采用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。

4、自 2020 年 10 月 28 日起，本基金分设两级基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额，详情请参阅相关公告。

## 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

诺安低碳经济股票 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	1.40%	0.80%	2.34%	1.23%	-0.94%	-0.43%
过去三个月	-3.83%	0.81%	-4.46%	1.22%	0.63%	-0.41%
过去六个月	3.69%	0.79%	-6.22%	1.08%	9.91%	-0.29%
过去一年	8.84%	0.90%	-24.41%	1.25%	33.25%	-0.35%
过去三年	73.17%	0.97%	43.62%	1.56%	29.55%	-0.59%
自基金合同生效起至今	138.80%	1.25%	27.71%	1.45%	111.09%	-0.20%

诺安低碳经济股票 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	1.41%	0.81%	2.34%	1.23%	-0.93%	-0.42%
过去三个月	-3.93%	0.81%	-4.46%	1.22%	0.53%	-0.41%
过去六个月	3.45%	0.79%	-6.22%	1.08%	9.67%	-0.29%
过去一年	8.32%	0.90%	-24.41%	1.25%	32.73%	-0.35%
自基金合同生效起至今	33.82%	0.93%	20.07%	1.57%	13.75%	-0.64%

注：1、本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$  中证内地低碳经济主题指数收益率  $+20\% \times$  中证全债指数收益率。

2、自 2020 年 10 月 28 日起，本基金分设两级基金份额：A 类基金份额和 C 类基金份额；其中 C 类基金份额自 2020 年 11 月 17 日开始有申购数据，C 类基金份额的指标计算自申购数据确认日（2020 年 11 月 18 日）算起。

### 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



诺安低碳经济股票 A



诺安低碳经济股票 C



## § 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

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十一只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、

诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金等。

#### 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		
韩冬燕	本基金基金经理	2023 年 02 月 18 日	-	19 年	硕士，具有基金从业资格。曾就职于华夏基金管理有限公司，先后从

					<p>事于基金清算、行业研究工作。2010年1月加入诺安基金管理有限公司,从事行业研究工作,现任公司总经理助理、权益投资事业部总经理。2015年11月起任诺安先进制造股票型证券投资基金基金经理,2016年9月起任诺安中小盘精选混合型证券投资基金基金经理,2017年6月起任诺安行业轮动混合型证券投资基金基金经理,2019年4月起任诺安恒鑫混合型证券投资基金基金经理,2023年2月起任诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理。</p>
李晓杰	本基金基金经理	2023年02月25日	-	10年	<p>硕士,具有基金从业资格。曾先后就职于东兴证券股份有限公司、新时代信托股份有限公司、华夏久盈资产管理有限责任公司,任投资经理。2023年2月加入诺安基金管理有限公司。2023年2月起任诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理。</p>
蔡宇滨	本基金基金经理	2019年01月22日	2023年02月18日	14年	<p>硕士,具有基金从业资格。曾任职于招商证券等,2014年3月加入诺安基金管理有限公司,历任研究员、投资经理。2017年12月至2021年3月任诺安平衡证券投资基金基金经理,2018年6月至2023年2月任诺安策</p>

					略精选股票型证券投资基金基金经理, 2019 年 1 月至 2023 年 2 月任诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①此处基金经理的任职日期、离任日期均为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了基金合同的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

## 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

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各

投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

#### 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。本报告期内基金管理人管理的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不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 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

在市场由强复苏转为弱复苏的背景下，一季度减持了医药生物和基础化工等顺周期板块，增加了科技股、电力和铁路配置，获取了超额收益。二季度考虑到市场对于经济过于悲观，沪深 300 指数估值也在历史低位，增加了银行、地产和保险等价值股配置，同时增加了权益类资产的仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安低碳经济股票 A 份额净值为 2.388 元，本报告期诺安低碳经济股票 A 份额净值增长率为 3.69%，同期业绩比较基准收益率为-6.22%；截至本报告期末诺安低碳经济股票 C 份额净值为 2.370 元，本报告期诺安低碳经济股票 C 份额净值增长率为 3.45%，同期业绩比较基准收益率为-6.22%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年国内经济恢复速度放缓，在弱复苏的背景下，市场呈现显著的结构化行情，以 AI 为主的科技创新板块在上半年来涨幅较大，而与经济相关性强的消费医药、地产产业链等顺周期板块整体低迷。不可否认，未来 AI 和人形机器人将大幅提高实体经济效率，但目前绝大部分公司的商业模式、盈利可持续性和产业竞争格局都有很大不确定性，我们认为目前 AI 和人形机器人还处于 0 到 1 的主题投资阶段，继续获取超额收益的难度将加大。

展望下半年，国内经济将保持持续修复，工业主动去库存接近尾声，叠加稳增长政策支持，预计实体经济将在下半年企稳回升，另外经历了二季度下跌，沪深 300 指数估值也处于历史低位，市场下行风险不大。

持仓结构方面，随着国内经济的长期增速逐步下台阶，能够带来长期稳定现金流的中国核心资产的估值将得到提升，另外随着治理改善，央企经营性现金流得到显著提升，这些央企的估值

也将会重估，以上这些中国核心资产是我们的基础仓位。同时我们也长期看好新技术、进口替代的投资机会，很多优质个股也因为市场交易因素跌幅较大，我们在二季度逆向投资的布局了军工、半导体和新能源相关标的。

综上，我们认为市场下行风险不大，我们将坚持努力寻找符合国家产业规划和经济发展形势的优质个股，同时保持深入研究和调研找到清晰的投资逻辑，力争为投资人带来更多超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值政策和程序。估值委员会由督察长、投资、研究、风险管理、法律合规和基金运营等部门负责人及指定人员组成，估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 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

截至本报告期末，本基金未出现连续 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 万元的情形。

## § 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合规守信、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——诺安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

本托管人依法对诺安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：诺安低碳经济股票型证券投资基金

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	92,287,938.84	169,522,431.11
结算备付金		2,082,468.72	17,886,930.67
存出保证金		516,390.78	357,940.84
交易性金融资产	6.4.7.2	864,084,248.33	2,104,527,619.62
其中：股票投资		864,084,248.33	2,104,527,619.62
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	-	229,942,520.55
应收清算款		347,360.64	2,928,442.90
应收股利		-	-
应收申购款		977,081.49	30,100,225.68
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		960,295,488.80	2,555,266,111.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2023年06月30日</b>	<b>2022年12月31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		5,000,062.16	24,493,187.87
应付赎回款		10,521,754.69	8,296,537.25
应付管理人报酬		1,305,521.93	3,385,587.74
应付托管费		217,586.99	564,264.67
应付销售服务费		132,504.61	445,853.72
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	2,103,332.82	2,421,731.52
负债合计		19,280,763.20	39,607,162.77
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	394,958,701.59	1,094,606,684.90
未分配利润	6.4.7.8	546,056,024.01	1,421,052,263.70
净资产合计		941,014,725.60	2,515,658,948.60
负债和净资产总计		960,295,488.80	2,555,266,111.37

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，诺安低碳经济股票 A 基金份额净值 2.388 元，基金份额总额 274,917,914.51 份；诺安低碳经济股票 C 基金份额净值 2.370 元，基金份额总额 120,040,787.08 份。诺安低碳经济股票份额总额合计为 394,958,701.59 份。

## 6.2 利润表

会计主体：诺安低碳经济股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		145,654,709.18	-73,820,934.77
1. 利息收入		1,020,843.44	1,582,971.02
其中：存款利息收入	6.4.7.9	402,730.41	412,252.76
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		618,113.03	1,170,718.26
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		169,320,448.25	-103,554,788.21
其中：股票投资收益	6.4.7.10	160,633,077.55	-123,773,316.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	297,869.29
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	8,687,370.70	19,920,658.68
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	-26,950,433.87	27,267,277.22
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	2,263,851.36	883,605.20
<b>减：二、营业总支出</b>		15,021,760.91	13,743,129.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,639,783.02	10,849,649.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,939,963.80	1,808,274.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,342,560.78	979,060.33
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	16,623.56
其中：卖出回购金融资产支出		-	16,623.56
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	1.29
8. 其他费用	6.4.7.17	99,453.31	89,520.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		130,632,948.27	-87,564,064.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		130,632,948.27	-87,564,064.10
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		130,632,948.27	-87,564,064.10

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诺安低碳经济股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 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)	1,094,606,684.90	-	1,421,052,263.70	2,515,658,948.60
二、本期期初净资产(基金净值)	1,094,606,684.90	-	1,421,052,263.70	2,515,658,948.60

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-699,647,983.31	-	-874,996,239.69	-1,574,644,223.00
(一)、综合收益总额	-	-	130,632,948.27	130,632,948.27
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-699,647,983.31	-	-1,005,629,187.96	-1,705,277,171.27
其中: 1. 基金申购款	205,379,544.76	-	296,676,054.06	502,055,598.82
2. 基金赎回款	-905,027,528.07	-	-1,302,305,242.02	-2,207,332,770.09
(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、本期期末净资产(基金净值)	394,958,701.59	-	546,056,024.01	941,014,725.60
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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)	368,443,130.76	-	477,278,278.47	845,721,409.23
二、本期期初净资产(基金净值)	368,443,130.76	-	477,278,278.47	845,721,409.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	368,236,258.60	-	400,969,496.54	769,205,755.14
(一)、综合收益总额	-	-	-87,564,064.10	-87,564,064.10
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	368,236,258.60	-	488,533,560.64	856,769,819.24
其中: 1. 基金申购款	760,179,767.40	-	910,234,526.62	1,670,414,294.02
2. 基金赎回款	-391,943,508.80	-	-421,700,965.98	-813,644,474.78
(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、本期期末净资产(基金净值)	736,679,389.36	-	878,247,775.01	1,614,927,164.37

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:

齐斌

基金管理人负责人

田冲

主管会计工作负责人

何柳姿

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

诺安低碳经济股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予诺安低碳经济股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕475号）批准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年5月12日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为3,785,949,626.11份基金份额，其中认购资金利息折合1,083,452.93份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金于2020年10月28日起进行基金份额分级，分级后本基金设两级基金份额：A级基金份额和C级基金份额。A级基金份额的基金代码为001208（与分级前基金代码相同），基金简称“诺安低碳经济股票A”；C级基金份额代码为010349，基金简称“诺安低碳经济股票C”。两级基金份额适用相同的管理费率、托管费率。本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，但不从该类别基金资产中计提销售服务费；C类基金份额在申购时不收取申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》和《诺安低碳经济股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票）、存托凭证、权证、股指期货等权益类投资工具，国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含分离交易可转债）、央票、中期票据、资产支持证券等固定收益类品种，短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等货币市场工具，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。

本基金为股票型基金，股票、存托凭证投资占基金资产净值的比例不低于基金资产的80%，其中投资于低碳经济主题相关股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%；权证占基金资产净值的比例不超过3%；扣除股指期货合约缴纳的保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《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》其他相关规定（以下合称“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制定的《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〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财税〔2012〕85 号《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》、财税〔2015〕101 号《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》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《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》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140 号

《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》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《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等其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税；存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、质押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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。自 2008 年 10 月 9 日起，暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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	92,287,938.84
等于：本金	92,278,505.73	
加：应计利息	9,433.11	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
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	-	
合计	92,287,938.84	

#### 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	853,307,130.61	-	864,084,248.33	10,777,117.72
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	853,307,130.61	-	864,084,248.33	10,777,117.72

#### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 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	7,383.60
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,996,770.27
其中：交易所市场	1,996,770.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	2,103,332.82

#### 6.4.7.7 实收基金

诺安低碳经济股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	684,333,224.57	684,333,224.57
本期申购	92,027,294.21	92,027,294.21
本期赎回（以“-”号填列）	-501,442,604.27	-501,442,604.27
本期末	274,917,914.51	274,917,914.51

诺安低碳经济股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	410,273,460.33	410,273,460.33
本期申购	113,352,250.55	113,352,250.55
本期赎回（以“-”号填列）	-403,584,923.80	-403,584,923.80
本期末	120,040,787.08	120,040,787.08

### 6.4.7.8 未分配利润

诺安低碳经济股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	920,143,704.28	-28,669,754.37	891,473,949.91
本期利润	102,026,928.21	-15,998,704.42	86,028,223.79
本期基金份额交易产生的变动数	-595,391,379.87	-483,802.08	-595,875,181.95
其中：基金申购款	137,328,194.81	-3,232,453.50	134,095,741.31
基金赎回款	-732,719,574.68	2,748,651.42	-729,970,923.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	426,779,252.62	-45,152,260.87	381,626,991.75

诺安低碳经济股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	547,153,761.88	-17,575,448.09	529,578,313.79
本期利润	55,556,453.93	-10,951,729.45	44,604,724.48
本期基金份额交易产生的变动数	-418,557,884.23	8,803,878.22	-409,754,006.01
其中：基金申购款	164,192,188.00	-1,611,875.25	162,580,312.75
基金赎回款	-582,750,072.23	10,415,753.47	-572,334,318.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	184,152,331.58	-19,723,299.32	164,429,032.26

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	306,135.78
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	85,694.50
其他	10,900.13
合计	402,730.41

注：此处“其他”列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

### 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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	3,583,036,018.46
减：卖出股票成本总额	3,414,065,439.58



减：交易费用	8,337,501.33
买卖股票差价收入	160,633,077.55

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益—买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	8,687,370.70
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	8,687,370.70

#### 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01月01日至2023年06月30日
1. 交易性金融资产	-26,950,433.87
—股票投资	-26,950,433.87
—债券投资	-
—资产支持证券投资	-
—基金投资	-
—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	-26,950,433.87

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,976,168.29
基金转换费收入	287,683.07
合计	2,263,851.36

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	274.36
合计	99,453.31

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明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
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 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01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,639,783.02	10,849,649.12
其中：支付销售机构的客户维护费	3,295,372.87	2,633,805.11

注：本基金的管理费率为年费率 1.50%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,939,963.80	1,808,274.82

注：本基金的托管费率为年费率 0.25%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

##### 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 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安低碳经济股票 A	诺安低碳经济股 票 C	合计
诺安基金管理有限公司	-	150,997.74	150,997.74
中国工商银行股份有限公司	-	59.46	59.46
合计	-	151,057.20	151,057.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安低碳经济股票 A	诺安低碳经济股 票 C	合计
诺安基金管理有限公司	-	153,553.44	153,553.44
中国工商银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	153,553.44	153,553.44

注：本基金诺安低碳经济股票 A 份额不收取销售服务费，诺安低碳经济股票 C 份额的年销售服务费年费率为 0.50%。

诺安低碳经济股票 C 的销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为诺安低碳经济股票 C 每日应计提的销售服务费

E 为诺安低碳经济股票 C 前一日的基金资产净值

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司-活期存款	92,287,938.84	306,135.78	321,964,367.09	243,150.42

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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
00128	三联	2023年	6个月	新股锁	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-

2	锻造	05月15日		定							
001286	陕西能源	2023年03月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-	
001287	中电港	2023年03月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-	
001324	长青科技	2023年05月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-	
001328	登康口腔	2023年03月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-	
001360	南矿集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-	
001367	海森药业	2023年03月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-	
001380	华纬科技	2023年05月09日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-	
300804	广康生化	2023年06月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-	
301141	中科磁业	2023年03月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-	
301157	华塑科技	2023年03月01日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-	
301170	锡南科技	2023年06月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-	
301202	朗威股份	2023年06月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-	
301202	朗威股份	2023年06月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-	
301203	国泰环保	2023年03月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-	

301210	金杨股份	2023年06月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年06月08日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023年06月08日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年03月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301260	格力博	2023年01月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年06月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年06月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年03月28日	6个月	新股锁定	31.50	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023年06月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023年06月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年06月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年04月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年06月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年02月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023年05月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023年04月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023年05月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023年06月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年06月01日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年02月27日	6个月	新股锁定	87.30	53.24	392	34,219.71	20,870.08	-
301323	新莱福	2023年05月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年05月04日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年05月09日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年05月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年03月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年06月02日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301355	北方	2023年	6个月	新股锁	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-



7	长龙	04月11日		定							
301358	湖南裕能	2023年02月01日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-	
301360	荣旗科技	2023年04月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-	
301373	凌玮科技	2023年01月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-	
301376	致欧科技	2023年06月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-	
301382	蜂助手	2023年05月09日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-	
301386	未来电器	2023年03月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-	
301387	光大同创	2023年04月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-	
301395	仁信新材	2023年06月21日	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-	
301395	仁信新材	2023年06月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-	
301397	溯联股份	2023年06月15日	6个月	新股锁定	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-	
301399	英特科技	2023年05月16日	6个月	新股锁定	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	
301408	华人健康	2023年02月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
301419	阿莱德	2023年02月02日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-	
301428	世纪恒通	2023年05月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	

301439	泓淋电力	2023年03月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023年06月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023年06月30日	6个月	新股锁定	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023年06月26日	6个月	新股锁定	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023年03月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023年03月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023年03月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023年03月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023年03月29日	6个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023年04月10日	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年04月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年04月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023年04月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	6,936	137,748.96	125,264.16	-

688334	西高院	2023年06月09日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	顾中科技	2023年04月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年05月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023年06月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年04月07日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023年05月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023年04月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	11,730	66,743.70	63,459.30	-
688472	阿特斯	2023年06月02日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	4,543	50,427.30	77,412.72	-
688478	晶升股份	2023年04月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023年05月04日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年03月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688507	索辰科技	2023年04月10日	6个月	新股锁定	165.92	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023年05月08日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年05月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
68853	日联	2023年	6个月	新股锁	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-

1	科技	03月24日		定						
688535	华海诚科	2023年03月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年06月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年05月08日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年05月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年05月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023年05月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年06月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年05月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年06月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年06月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年06月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年05月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年06月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年06月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

		日								
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--	--

注：1、基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

2、本基金持有的流通受限股票“301281 科源制药”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4 股；本基金持有的流通受限股票“301322 绿通科技”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股；本基金持有的流通受限股票“688507 索辰科技”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积金向全体股东每股转增 0.48 股；以上流通受限股票转增股本数量与金额已包含在上述披露的数据中。

#### 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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动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。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的观念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理

下，建立了由督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

#### 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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，因而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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券市值的 10%。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金无债券投资（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 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要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内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，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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例低于 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 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得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上独立于市场利率变化。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收申购款等。

#### 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	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	92,287,938.84	-	-	-	-	92,287,938.84
结算备付金	2,082,468.72	-	-	-	-	2,082,468.72
存出保证金	516,390.78	-	-	-	-	516,390.78
交易性金融资产	-	-	-	-	864,084,248.33	864,084,248.33
应收清算款	-	-	-	-	347,360.64	347,360.64
应收申购款	-	-	-	-	977,081.49	977,081.49
资产总计	94,886,798.34	-	-	-	865,408,690.46	960,295,488.80
负债						
应付清算款	-	-	-	-	5,000,062.16	5,000,062.16
应付赎回款	-	-	-	-	10,521,754.69	10,521,754.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,305,521.93	1,305,521.93
应付托管费	-	-	-	-	217,586.99	217,586.99
应付销售服务费	-	-	-	-	132,504.61	132,504.61
其他负债	-	-	-	-	2,103,332.82	2,103,332.82
负债总计	-	-	-	-	19,280,763.20	19,280,763.20
利率敏感度缺口	94,886,798.34	-	-	-	846,127,927.26	941,014,725.60
上年度末 2022年12月31 日	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	169,522,431.11	-	-	-	-	169,522,431.11
结算备付金	17,886,930.67	-	-	-	-	17,886,930.67
存出保证金	357,940.84	-	-	-	-	357,940.84
交易性金融资产	-	-	-	-	2,104,527,619.62	2,104,527,619.62
买入返售金融资产	229,942,520.55	-	-	-	-	229,942,520.55
应收清算款	-	-	-	-	2,928,442.90	2,928,442.90
应收申购款	19,999,760.00	-	-	-	10,100,465.68	30,100,225.68



资产总计	437,709,583.17	-	-	-	2,117,556,528.20	2,555,266,111.37
负债						
应付清算款	-	-	-	-	24,493,187.87	24,493,187.87
应付赎回款	-	-	-	-	8,296,537.25	8,296,537.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,385,587.74	3,385,587.74
应付托管费	-	-	-	-	564,264.67	564,264.67
应付销售服务费	-	-	-	-	445,853.72	445,853.72
其他负债	-	-	-	-	2,421,731.52	2,421,731.52
负债总计	-	-	-	-	39,607,162.77	39,607,162.77
利率敏感度缺口	437,709,583.17	-	-	-	-2,077,949,365.43	2,515,658,948.60

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2022 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 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

其他价格风险是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单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，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，通过投资组合的分散化等方式，来主动应对可能发生的其他价格风险。

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，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时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	上年度末
----	-----	------

	2023 年 06 月 30 日		2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	864,084,248.33	91.82	2,104,527,619.62	83.66
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	864,084,248.33	91.82	2,104,527,619.62	83.66

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	7,635,908.71	45,245,635.43
	业绩比较基准下降 5%	-7,635,908.71	-45,245,635.43

### 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

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	861,480,716.35	2,102,961,069.44
第二层次	865,434.18	—
第三层次	1,738,097.80	1,566,550.18
合计	864,084,248.33	2,104,527,619.62

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易

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

本基金本报告期末及上年度末均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，其剩余期限较短，账面价值与公允价值相差很小。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需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	864,084,248.33	89.98
	其中：股票	864,084,248.33	89.98
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	94,370,407.56	9.83
8	其他各项资产	1,840,832.91	0.19
9	合计	960,295,488.80	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	34,366,251.00	3.65
C	制造业	411,315,724.43	43.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,698,695.47	5.39
E	建筑业	79,746,516.15	8.47
F	批发和零售业	31,819,113.25	3.38
G	交通运输、仓储和邮政业	57,903,504.60	6.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,137,553.52	7.67
J	金融业	67,464,646.00	7.17
K	房地产业	29,969,000.00	3.18
L	租赁和商务服务业	12,960,000.00	1.38
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	22,566.57	0.00
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	15,642,500.00	1.66
S	综合	-	-
	合计	864,084,248.33	91.82

### 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	601390	中国中铁	8,700,000	65,946,000.00	7.01
2	600048	保利发展	2,300,000	29,969,000.00	3.18
3	601985	中国核电	4,197,200	29,590,260.00	3.14
4	601816	京沪高铁	5,483,200	28,841,632.00	3.06
5	600519	贵州茅台	16,800	28,408,800.00	3.02
6	601318	中国平安	520,600	24,155,840.00	2.57
7	600036	招商银行	736,400	24,124,464.00	2.56
8	600941	中国移动	250,000	23,325,000.00	2.48
9	000858	五粮液	136,200	22,278,234.00	2.37
10	601899	紫金矿业	1,815,100	20,637,687.00	2.19
11	002371	北方华创	60,000	19,059,000.00	2.03
12	688012	中微公司	120,000	18,774,000.00	2.00

13	000333	美的集团	312,340	18,403,072.80	1.96
14	000063	中兴通讯	400,000	18,216,000.00	1.94
15	000568	泸州老窖	81,700	17,121,869.00	1.82
16	601006	大秦铁路	2,000,000	14,860,000.00	1.58
17	601058	赛轮轮胎	1,300,000	14,807,000.00	1.57
18	003816	中国广核	4,599,800	14,305,378.00	1.52
19	300274	阳光电源	120,000	13,995,600.00	1.49
20	601186	中国铁建	1,400,000	13,790,000.00	1.47
21	600309	万华化学	156,100	13,711,824.00	1.46
22	600713	南京医药	2,514,100	13,500,717.00	1.43
23	000768	中航西飞	500,000	13,375,000.00	1.42
24	002654	万润科技	1,500,000	12,960,000.00	1.38
25	600482	中国动力	550,000	12,892,000.00	1.37
26	600760	中航沈飞	280,000	12,600,000.00	1.34
27	300109	新开源	500,000	12,435,000.00	1.32
28	301236	软通动力	446,730	12,155,523.30	1.29
29	600426	华鲁恒升	386,800	11,847,684.00	1.26
30	000963	华东医药	253,800	11,007,306.00	1.17
31	603986	兆易创新	100,000	10,625,000.00	1.13
32	300316	晶盛机电	146,300	10,372,670.00	1.10
33	002179	中航光电	226,800	10,285,380.00	1.09
34	600570	恒生电子	230,000	10,186,700.00	1.08
35	688110	东芯股份	277,714	10,025,475.40	1.07
36	601939	建设银行	1,600,000	10,016,000.00	1.06
37	688111	金山办公	21,203	10,012,480.66	1.06
38	002475	立讯精密	303,000	9,832,350.00	1.04
39	603501	韦尔股份	98,630	9,669,685.20	1.03
40	601111	中国国航	1,125,900	9,277,416.00	0.99
41	688981	中芯国际	181,872	9,188,173.44	0.98
42	601601	中国太保	352,900	9,168,342.00	0.97
43	300604	长川科技	190,100	9,027,849.00	0.96
44	300413	芒果超媒	250,000	8,552,500.00	0.91
45	300130	新国都	300,000	8,499,000.00	0.90
46	688153	唯捷创芯	115,868	8,476,902.88	0.90
47	002459	晶澳科技	192,300	8,018,910.00	0.85
48	300170	汉得信息	653,700	7,543,698.00	0.80
49	000034	神州数码	271,800	7,227,162.00	0.77
50	300133	华策影视	1,000,000	7,090,000.00	0.75
51	600583	海油工程	1,200,000	7,020,000.00	0.75
52	000862	银星能源	883,500	6,767,610.00	0.72
53	600968	海油发展	2,185,200	6,708,564.00	0.71

54	301013	利和兴	442,500	6,327,750.00	0.67
55	300682	朗新科技	258,100	6,008,568.00	0.64
56	688106	金宏气体	191,308	5,203,577.60	0.55
57	600933	爱柯迪	218,000	5,077,220.00	0.54
58	600537	亿晶光电	657,100	5,020,244.00	0.53
59	603871	嘉友国际	313,460	4,924,456.60	0.52
60	301278	快可电子	74,790	4,861,350.00	0.52
61	603699	纽威股份	287,300	4,275,024.00	0.45
62	688786	悦安新材	86,119	3,995,060.41	0.42
63	000977	浪潮信息	80,400	3,899,400.00	0.41
64	688196	卓越新能	66,124	3,058,235.00	0.32
65	300045	华力创通	260,700	3,024,120.00	0.32
66	300395	菲利华	58,900	2,897,880.00	0.31
67	002605	姚记科技	60,000	2,785,800.00	0.30
68	688213	思特威	53,757	2,749,132.98	0.29
69	688269	凯立新材	37,889	2,416,939.31	0.26
70	688375	国博电子	26,104	2,067,436.80	0.22
71	688290	景业智能	28,927	1,929,720.17	0.21
72	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.03
73	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
74	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
75	688249	晶合集成	6,936	125,264.16	0.01
76	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
77	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
78	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
79	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
80	688472	阿特斯	4,543	77,412.72	0.01
81	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
82	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.01
83	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
84	688469	中芯集成	11,730	63,459.30	0.01
85	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.01
86	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
87	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
88	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
89	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
90	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
91	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
92	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
93	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
94	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00

95	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
96	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
97	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
98	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
99	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
100	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
101	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
102	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
103	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
104	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
105	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
106	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
107	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
108	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
109	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
110	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
111	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
112	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
113	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
114	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
115	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
116	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
117	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
118	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
119	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
120	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
121	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
122	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
123	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
124	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
125	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
126	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
127	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
128	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
129	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
130	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
131	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
132	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
133	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
134	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
135	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00

136	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
137	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
138	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
139	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
140	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
141	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
142	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
143	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
144	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
145	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
146	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
147	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
148	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
149	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
150	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
151	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
152	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
153	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
154	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
155	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
156	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
157	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
158	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
159	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
160	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
161	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
162	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
163	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
164	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
165	603172	万丰股份	122	1,967.86	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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	49,976,364.76	1.99
2	601939	建设银行	47,997,079.30	1.91
3	600036	招商银行	44,988,104.50	1.79
4	600941	中国移动	43,949,044.00	1.75
5	600048	保利发展	42,058,504.08	1.67



6	601985	中国核电	41,255,274.57	1.64
7	600030	中信证券	39,995,557.60	1.59
8	300750	宁德时代	39,934,058.86	1.59
9	601186	中国铁建	34,997,590.62	1.39
10	300133	华策影视	34,997,301.70	1.39
11	300274	阳光电源	31,959,373.00	1.27
12	601006	大秦铁路	31,346,501.89	1.25
13	601816	京沪高铁	30,998,103.00	1.23
14	600570	恒生电子	29,994,382.10	1.19
15	600519	贵州茅台	29,703,066.00	1.18
16	601390	中国中铁	29,343,060.00	1.17
17	688012	中微公司	27,967,962.08	1.11
18	000858	五粮液	27,478,164.00	1.09
19	002459	晶澳科技	26,412,737.60	1.05
20	002925	盈趣科技	26,176,175.20	1.04

注：买入金额按成交金额(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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	156,116,143.44	6.21
2	000002	万科A	85,837,391.97	3.41
3	601390	中国中铁	77,507,194.00	3.08
4	601318	中国平安	76,927,198.48	3.06
5	002415	海康威视	75,796,700.81	3.01
6	002410	广联达	48,015,804.21	1.91
7	000063	中兴通讯	43,734,284.40	1.74
8	603707	健友股份	42,880,947.65	1.70
9	300394	天孚通信	40,267,334.54	1.60
10	000651	格力电器	40,075,912.76	1.59
11	601117	中国化学	39,378,403.04	1.57
12	600030	中信证券	39,248,407.10	1.56
13	002463	沪电股份	38,606,067.10	1.53
14	300750	宁德时代	38,471,513.00	1.53
15	601006	大秦铁路	38,460,130.73	1.53
16	300630	普利制药	37,588,191.17	1.49
17	601939	建设银行	37,360,205.10	1.49
18	002001	新和成	36,421,335.61	1.45
19	688503	聚和材料	35,398,762.52	1.41
20	600938	中国海油	34,651,889.23	1.38

注：卖出金额按成交金额(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	2,200,572,502.16
卖出股票收入（成交）总额	3,583,036,018.46

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(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

本基金本报告期末投资股指期货。

### 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

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体，除中国平安、招商银行外，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 中国平安保险（集团）股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局深圳市分局的行政处罚。

截至本报告期末，中国平安（601318）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该处罚不会影响公司正常经营和长期竞争力，目前该公司估值较低，具备长期投资价值，从投资价值分析本基金将继续持有中国平安。

(2) 招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国银行间市场交易商协会的行政处罚。

截至本报告期末，招商银行（600036）为本基金前十大重仓股。从投资的角度看，我们认为该公司估值处于历史底部，上述行政监管措施并不影响公司的长期竞争力。因此本基金才继续持有招商银行。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

### 7.12.2 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

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 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	516,390.78
2	应收清算款	347,360.64
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	977,081.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,840,832.91

### 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

本基金本报告期末持有的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

由于四舍五入原因，投资组合报告中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
诺安低碳经济股票 A	56,566	4,860.13	28,757,874.79	10.46%	246,160,039.72	89.54%
诺安低碳经济股票 C	15,672	7,659.57	88,680,015.01	73.87%	31,360,772.07	26.13%
合计	72,238	5,467.46	117,437,889.80	29.73%	277,520,811.79	70.27%

注：1、分级基金机构/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）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 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（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	诺安低碳经济股票 A	8,733.32	0.0032%
	诺安低碳经济股票 C	56.47	0.0000%
	合计	8,789.79	0.0022%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	诺安低碳经济股票 A	0
	诺安低碳经济股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放	诺安低碳经济股票	0

式基金	A	
	诺安低碳经济股票	0
	C	
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安低碳经济股票 A	诺安低碳经济股票 C
基金合同生效日（2015 年 05 月 12 日）基金份额总额	3,785,949,626.11	-
本报告期期初基金份额总额	684,333,224.57	410,273,460.33
本报告期基金总申购份额	92,027,294.21	113,352,250.55
减：本报告期基金总赎回份额	501,442,604.27	403,584,923.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	274,917,914.51	120,040,787.08

## § 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，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内，本基金管理人重大人事变动情况如下：

俞任君先生担任公司监事，赵星明先生、梅律吾先生不再担任公司监事。

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，无涉及本基金管理人基金管理业务、本基金基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

### 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，本基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 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，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	776,631,533.61	13.47%	723,268.16	16.83%	-
东方财富证券	1	2,088,536,434.66	36.23%	879,909.89	20.48%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
华创证券	1	2,327,594,104.49	40.38%	2,167,713.18	50.44%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	571,504,853.15	9.91%	526,526.27	12.25%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期增加 2 个证券公司 2 个交易单元：宏信证券有限责任公司（1 个交易单元）、首创证券股份有限公司（1 个交易单元）。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易席位的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
  - (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
  - (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
  - (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
  - (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
  - (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。
- 基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

### 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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	4,430,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2023 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年01月05日
2	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年01月05日
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年01月05日
4	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年01月20日
5	诺安低碳经济股票型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站	2023年01月20日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加富滇银行股份有限公司为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2023年02月06日
7	诺安基金管理有限公司关于诺安低碳经济股票 C 增加奕丰基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2023年02月07日
8	诺安低碳经济股票型证券投资基金变更基金经理的公告	《中国证券报》	2023年02月18日
9	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书、基金产品资料概要(更新)的提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2023年02月22日
10	诺安低碳经济股票型证券投资基金招募说明书(更新)2023 年第 1 期	基金管理人网站	2023年02月22日



11	诺安低碳经济股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023年02月22日
12	诺安低碳经济股票型证券投资基金增聘基金经理的公告	《中国证券报》	2023年02月25日
13	诺安低碳经济股票型证券投资基金招募说明书（更新）2023年第2期	基金管理人网站	2023年03月01日
14	诺安低碳经济股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023年03月01日
15	诺安低碳经济股票型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《中国证券报》	2023年03月01日
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加济安财富为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月03日
17	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月15日
18	诺安低碳经济股票型证券投资基金招募说明书（更新）2023年第3期	基金管理人网站	2023年03月17日
19	诺安低碳经济股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站	2023年03月17日
20	诺安低碳经济股票型证券投资基金基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《中国证券报》	2023年03月17日
21	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加银泰证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月20日
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加南京证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月29日
23	诺安基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年03月31日
24	诺安低碳经济股票型证券投资基金 2022 年年度报告	基金管理人网站	2023年03月31日
25	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大连网金基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年04月14日

26	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年04月20日
27	诺安低碳经济股票型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站	2023年04月22日
28	诺安基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年04月22日
29	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加博时财富为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年05月15日
30	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国工商银行为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2023年05月18日
31	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行开展基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2023年05月24日

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站进行披露。

## § 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

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%的情形，敬请投资者留意。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2023 年 8 月 26 日披露了《诺安基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，调低本基金的管理费率及托管费率，

并对基金合同等法律文件的有关条款进行修订。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安低碳经济股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安低碳经济股票型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。
- ⑤报告期内诺安低碳经济股票型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 [www.lionfund.com.cn](http://www.lionfund.com.cn) 查阅详情。

诺安基金管理有限公司  
2023 年 08 月 31 日