广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金

2025 年第 3 季度报告

2025年9月30日

基金管理人:广发基金管理有限公司基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇二五年十月二十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发中证上海环交所碳中和 ETF
场内简称	碳中和
基金主代码	560550
交易代码	560550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022年7月11日
报告期末基金份额总额	371,597,408.00 份
	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最
机次口标	小化。在正常情况下,本基金力争控制投资组合的
投资目标 	净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离
	度的绝对值小于 0.2%, 年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成

股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据
的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。
基金投资于标的指数成份股及备选成份股(含存
凭证)的比例不低于基金资产净值的90%且不低
非现金基金资产的80%。
正常情况下,本基金力争控制投资组合的净值增
率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝
值小于 0.2%, 年化跟踪误差不超过 2%。
体投资策略包括: 1、股票(含存托凭证)投资
略; 2、债券投资策略; 3、资产支持证券投资策
; 4、股指期货投资策略; 5、参与转融通证券出
业务策略。
证上海环交所碳中和指数收益率
基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基
、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型
金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,
有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场
似的风险收益特征。
发基金管理有限公司

注: 本基金的扩位证券简称为"碳中和 ETF 龙头"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

	报告期
主要财务指标	(2025年7月1日-2025年9月30
	日)

1.本期已实现收益	1,194,141.99
2.本期利润	114,729,772.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.2400
4.期末基金资产净值	377,087,447.41
5.期末基金份额净值	1.0148

- 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。

3.2 基金净值表现

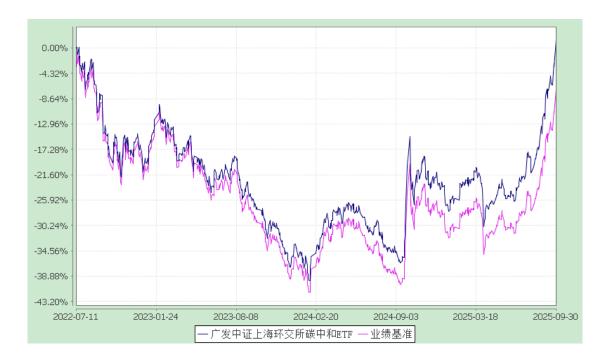
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增 长率①	净值增 长率标 准差②	业绩比 较基准 收益率 ③	业绩比 较基准 收益率 标准差 ④	1)-(3)	2-4
过去三个 月	33.00%	1.19%	31.85%	1.20%	1.15%	-0.01%
过去六个 月	31.86%	1.27%	29.49%	1.28%	2.37%	-0.01%
过去一年	27.17%	1.41%	23.33%	1.43%	3.84%	-0.02%
过去三年	24.00%	1.26%	15.43%	1.28%	8.57%	-0.02%
自基金合 同生效起 至今	1.48%	1.27%	-6.98%	1.29%	8.46%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年7月11日至2025年9月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基 金经理期限		证券 从业	说明
71.71	4/1/3	任职 日期	离任 日期	年限	hr.\1
陆志明	本基金的基金经理; 定生指汽车指数型 发电证全指汽车指数型的 基金经理; 广发基金证为时, 基金统材料指数型的型型。 发型; 大型,一个交易型,一个一个交易型,一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	2022- 07-11	<u>一</u>	26.4 年	陆志明先生,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员,深圳证券信息有限公司部门总监,广发基金管理、后发型开放武指数设理、量化投资部副总经理、广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金联接基数证券投资基金联接基

金经理;广发中证央企 创新驱动交易型开放式 指数证券投资基金的基 金经理;广发中证全指 电力公用事业交易型开 放式指数证券投资基金 的基金经理; 广发中证 全指家用电器交易型开 放式指数证券投资基金 的基金经理; 广发中证 全指家用电器交易型开 放式指数证券投资基金 联接基金的基金经理; 广发中证全指电力公用 事业交易型开放式指数 证券投资基金发起式联 接基金的基金经理;广 发中证上海环交所碳中 和交易型开放式指数证 券投资基金发起式联接 基金的基金经理:广发 中证沪港深科技龙头交 易型开放式指数证券投 资基金的基金经理;广 发国证粮食产业交易型 开放式指数证券投资基 金的基金经理;广发中 证 A500 交易型开放式 指数证券投资基金联接 基金的基金经理:广发 中证 A50 指数型证券投 资基金的基金经理

金基金经理(自 2011 年 6 月9日至2016年7月28 日)、广发深证 100 指数分 级证券投资基金基金经 理(自 2012 年 5 月 7 日至 2016年7月28日)、广发 中证百度百发策略 100 指 数型证券投资基金基金 经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、 广发中证医疗指数分级 证券投资基金基金经理 (自 2015 年 7 月 23 日至 2016年7月28日)、广发 中证全指能源交易型开 放式指数证券投资基金 发起式联接基金基金经 理(自 2015 年 7 月 9 日至 2018年10月9日)、广发 中证全指主要消费交易 型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金基 金经理(自 2015 年 8 月 18 日至2018年12月20日)、 广发中证全指原材料交 易型开放式指数证券投 资基金发起式联接基金 基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消 费交易型开放式指数证 券投资基金基金经理(自 2015年7月1日至2019 年4月2日)、广发中证全 指工业交易型开放式指 数证券投资基金发起式 联接基金基金经理(自 2017年6月13日至2020 年8月21日)、广发中证 全指工业交易型开放式 指数证券投资基金基金 经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2021 年 2 月 10 日)、 广发中证全指可选消费

交易型金经型(自 2014年6月3,广发型量全 4年6月17日上,大交及型基金 基金经型(自 2014年6月17日上,大交及型基金 基金经理(自 2014年6月17日,广发型平放工金指指数理自 2015年1月15度。 一个工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工	T T), H = 1 - 2
2014年6月3日至2021年6月17日),广发中证全指医数证务基金基金经基金经基金经过自2014年6月17日),广及中证全指信数证券数值自2014年6月17日),广发中证全指信数工产发验基金基金经过自2015年1月日,广发型基金经过工年6月17日),广交型工产发表证式式式联联基金区型(自2015年1月201年6月17日),广交设置基金经理(自2015年6月17日),广交投资基金基金经理(自2015年6月17日),广安设置基金经理(自2015年6月17日),广发中亚全指指数准建设自2015年6月17日),广发型基金经过工作6月17日),广发型基金经过工作6月17日),广发型工作6月月7日,广发型工作6月月7日,广发型工作6月月7日,广发型工作6月月7日,广发型工作6月月7日,交易基金经理(自2015年6月月),广发中正企全指数证经理(自2015年6月月),广发中正企全指数证经过(自2015年6月月),广发中正全指数证经过(自2015年6月月),广发型工作分别是基金经过(自201年6月),广发中正全指数证经过(自201年6月),广发中工企省上,广发中工企省上,17日,广发中工企省上,17日,广发中工企省上,17日,广发中工企省上,17日,广发中工企省上,17日,广发中工企省上,17日,广发中工企省上,17日,广发中工企省上,17日,广发中工企省上,17日,17日,17日,17日,17日,17日,17日,17日,17日,17日		交易型井放式指数证券
年6月17日)、广发中亚 全指因至少2月2日年6月17日)、广发中亚全指图数证券投资年12月1日至2021年6月17日)、广发型证金指图工作自息技术交易型基金经理(自2015年1月日)、广发型工产工产。1月18日,1月18日,1月28日,		投资基金基金经理(自
年6月17日)、广发中亚 全指因至少2月2日年6月17日)、广发中亚全指图数证券投资年12月1日至2021年6月17日)、广发型证金指图工作自息技术交易型基金经理(自2015年1月日)、广发型工产工产。1月18日,1月18日,1月28日,		2014年6月3日至2021
全指医数证多投资基金基金经型位 2014 年 12 月1 广发中证全指信息技术交资基显全经型值 2021 年 6 月 17 日下发中亚全指信息技术交易资基金经 1		
放武经理自 2014 年 12 月1日至 2021年 6月 17 日),广安中证全指信息数证		, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
基金经理(自 2014 年 12 月 1 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息数不交易型开放或指数理的 2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发即证金指信数证券投资基金经验理(自 2015 年 1 月 29 甲次交易 基金基金全型(自 2015 年 1 月 29 中证全指信息被诉查 基金全型(自 2015 年 6 月 17 日)、广发中证全指组理(自 2015 年 6 月 17 日)、广发中证全指数证券投资基金经型(自 2015 年 6 月 17 日)、广发中证全指数证券投资基金经型(自 2015 年 4 月 15 日产发中证全指度对正条投资基金经理(自 2015 年 6 月 17 日)、广发中证全指原对社会发展,发展工会发展,发展工程,发展工程,发展工程,发展工程,发展工程,发展工程,发展工程,发展		
月1日至2021年6月17日)、广发中证全指信息技术交易型基基金经理(自2015年1月8日至2021年6月17日)、广发中证全指信息技术交易基基金经理(自2015年1月29日产发表。 2021年6月17日)、广发中证全指省数证券投资基金经理(自2015年1月29日产发中证全指金额上的产产,17日,交易型于放大型,17日,广发中证全指的工程,17日,广发中证金指的工程,17日,广发中证金指的工程,17日,广发中证金指的工程,17日,广发中证金指的工程,17日,广发中证金指的工程,17日,广发中证全指数证券上。 2021年6月17日)、广发中证全指人工程,2021年6月17日)、一发中证全指人工程,2021年6月17日),一发中正全指数证券投资基金经理(自2015年6月17日),广发中证金指数证券投资基金基金经理(自2015年6月17日),广发中证全指数证券投资基金基金经理(自2015年6月17日),广发中证全指数证券投资基金基金经理(自2015年6月17日),广发中证金指数证券投资基金基金经理(自2015年6月17日),广发中证金指金融地产交易型开放式		
日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年1月8日至2011年6月17日)、广发型开放式指数证券投资基金经理(自2015年1月29日至全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金经理(自2015年1月17日)、广发中型证金指数证产量量量2011年6月17日)、广发中型正放发起工式工程,是有15日至2021年6月17日)、广发中型全指生数证券投资基金经理(自2015年4月17日)、广发中型全指生数证券投资基金经理(自2015年5月6月17日)、广发中证金指数证差数量至2021年6月17日)、广发中证金指数证是2015年6月17日)、广发中证金指数证券投资基金经理(自2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证子投资基金基金经理(自25日至2021年6月17日)、广发中证全指		基金经理(自 2014 年 12
不交易型垂基金经理(自 2015年1月8日至 2021年6月18日至 2021年6月18日至 2021年6月18日至 2015年1月29日至 2021年6月17日)、广发中证全指指数证券基金经理(自 2015年1月20日年6月17日)、广发中证全指式指数证券基金区 2021年6月17日)、广发型垂流式式 联接基金经理 2021年6月17日)、广发中证全指式 数证券基金经理 2021年6月17日)、广发中证全指指数证券投资基金经理自 2015年5月6月17日)、广发中证会指看 17日)、广发中证会指表 17年10年10年11年10年11年10年11年10年11年11年11年11年11年		月1日至2021年6月17
不交易型垂基金经理(自 2015年1月8日至 2021年6月18日至 2021年6月18日至 2021年6月18日至 2015年1月29日至 2021年6月17日)、广发中证全指指数证券基金经理(自 2015年1月20日年6月17日)、广发中证全指式指数证券基金区 2021年6月17日)、广发型垂流式式 联接基金经理 2021年6月17日)、广发中证全指式 数证券基金经理 2021年6月17日)、广发中证全指指数证券投资基金经理自 2015年5月6月17日)、广发中证会指看 17日)、广发中证会指表 17年10年10年11年10年11年10年11年10年11年11年11年11年11年		日)、广发中证全指信息技
券投资基金基金经理(自 2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信数证券投资基金经定式联接基金经定式联接基金经理(自 2015 年 1 月 29 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融证券投资基金基金是理(自 2015 年 1 月 20 日 20 日 6 月 17 日)、广发中证全指可选,并发资基金经理(自 2015 年 4 月 15 日 至 20 日 年 6 月 17 日)、广发型开放之起式联接基金经至理(自 2015 年 5 月 6 月 17 日)、交易型开放式指数证券投资基金经变变的工作。 6 月 17 日)、交易型开放式指数联基金经理(自 2015 年 6 月 17 日)、广发型中证或式指数证券投资中证分量,并成式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式的工作。 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		术交易型开放式指数证
2015年1月8日至2021年6月17日)、广发中证全指信息技术交易型开放式起式联接基金经理(自2015年1月9)广发电证金指金融地产交易型开放式指数证券投资基金经理(自2015年1月17日)、广发中证全指可选消费型基金经理(自2015年3月17日)、广发中证全指可选消费型基金经理(自2015年4月15日至2021年6月17日)、广发中亚全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金经理(自2015年5月6日至发起式计数证券投资基金经理(自2015年6月17日)、广发中证全指原材料交易基金发理(自2015年6月17日)、广发中证全指原材料交易基金经理(自2015年6月17日)、广发中证全指版交易型开放式指数证券投资基金经理(自2015年6月17日)、广发中证全指源交易型共放式指数设置。		,
年6月17日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券金经理自2015年1月29日至2021年6月17日)、广发中证全指金融班产产分易型开放式给工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工		`
全指信息技术交易型基金发起式联接基金基经理(自 2015 年 1 月 1 月 2)、广发中证全指金数数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费交资基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指或批联接基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指或证券投资基金发理(自 2015 年 5 月 6 户 至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材实产。最上实产。是一个专用的工作,是一个专用的工作。是一个专用的工作,是一个工作,是一		
放式指数证券投资基金经理(自 2015年1月29日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年3月23日至2021年6月17日)、广发型开放式指数证券投资基金经理(自 2015年4月15日至2021年6月17日)、广发中证全指医药证券投资基金经理(自 2015年5月6日至2021年6月17日)、广发中证金指原标券投资基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指原标券投资基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指		
发起式联接基金基金经理(自 2015年1月29日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年3月23日至2021年6月17日)、广发中证全指指数证券投资基金经理(自 2015年4月15日至2021年6月17日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金经理(自 2015年5月6日至2021年6月17日)、广发中证全指原材料交资基金发理(自 2015年6月17日)、广发中证全指原材料交资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指		
理(自 2015年 1 月 29 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 3 月 23 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015年 4 月 15 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接车 5 月 6 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交资基金发起(自 2015年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交资基金基金经理(自 2015年 6 月 17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 6 月 25 日至 2021年 6 月 17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 6 月 25 日至 2021年 6 月 17日)、广发中证全指		放式指数证券投资基金
理(自 2015年 1 月 29 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 3 月 23 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015年 4 月 15 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接车 5 月 6 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交资基金发起(自 2015年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交资基金基金经理(自 2015年 6 月 17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 6 月 25 日至 2021年 6 月 17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 6 月 25 日至 2021年 6 月 17日)、广发中证全指		发起式联接基金基金经
2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年3月23日至 2021年6月17日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015年4月15日至 2021年6月17日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基基金经理(自 2015年5月6日至2021年6月17日)、广发中证全指原材料交资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指		理(自 2015年1月29日至
中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		(, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式,广发中证全指能源交易型开放式,广发中证全指金融地产交易型开放式		, , , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015年 5 月 6 日至 2021年 6 月 17日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 6 月 25 日至 2021年 6 月 17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 6 月 25 日至 2021年 6 月 17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 6 月 25 日至 2021年 6 月 17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		, ,,,,,,, _ , , , , , , , , , , ,
3月23日至2021年6月17日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年4月15日至2021年6月17日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年5月6日至2021年6月17日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		
17 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年4月15日至2021年6月17日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年5月6日至2021年6月17日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		,
选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年4月15日至2021年6月17日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年5月6日至2021年6月17日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		3月23日至2021年6月
数证券投资基金发起式 联接基金基金经理(自 2015年4月15日至2021 年6月17日)、广发中证 全指医药卫生交易型开 放式指数证券投资基金 发起式联接基金基金经 理(自 2015年5月6日至 2021年6月17日)、广发 中证全指原材料交易型 开放式指数证券投资基 金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交 易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交 易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指 金融地产交易型开放式		17 日)、广发中证全指可
联接基金基金经理(自 2015年4月15日至2021年6月17日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015年5月6日至2021年6月17日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		选消费交易型开放式指
联接基金基金经理(自 2015年4月15日至2021年6月17日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015年5月6日至2021年6月17日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		数证券投资基金发起式
2015年4月15日至2021 年6月17日)、广发中证 全指医药卫生交易型开 放式指数证券投资基金 发起式联接基金基金经 理(自2015年5月6日至 2021年6月17日)、广发 中证全指原材料交易型 开放式指数证券投资基 金基金经理(自2015年6月17日)、广发中证全指能源交 易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指 原科型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月17日)、广发中证全指 金融地产交易型开放式		
年6月17日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年5月6日至2021年6月17日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		,
全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年 6 月 25 日至 2021年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		
放式指数证券投资基金 发起式联接基金基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		
发起式联接基金基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		
理(自 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		放式指数证券投资基金
2021年6月17日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		发起式联接基金基金经
2021年6月17日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		理(自 2015 年 5 月 6 日至
中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		,
开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		
金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交 易型开放式指数证券投 资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指 金融地产交易型开放式		· ·
月25日至2021年6月17日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		
日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015年6月25日至2021年6月17日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		`
易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指 金融地产交易型开放式		, , , ,
资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指 金融地产交易型开放式		日)、广发中证全指能源交
资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指 金融地产交易型开放式		易型开放式指数证券投
年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指 金融地产交易型开放式		
月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式		`
金融地产交易型开放式		
		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
		指数证券投资基金发起

式联接基金基金经理(自 2015年7月9日至2021 年6月17日)、广发中证 全指家用电器指数型发 起式证券投资基金基金 经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年 5 月 10 日)、 广发中证 1000 指数型发 起式证券投资基金基金 经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年 11 月 22 日)、 广发深证 100 指数证券投 资基金 (LOF) 基金经理 (自 2021 年 6 月 17 日至 2024年7月3日)、广发 中证 1000 交易型开放式 指数证券投资基金联接 基金基金经理(自 2022 年 11月23日至2024年8月 8日)、广发中证沪港深科 技龙头交易型开放式指 数证券投资基金发起式 联接基金基金经理(自 2023年7月25日至2024 年 10 月 31 日)、广发中证 A500 指数型证券投资基 金基金经理(自 2024年11 月5日至2024年11月17 日)。

注: 1.对基金的首任基金经理,"任职日期"为基金合同生效日/转型生效日, "离任日期"为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理,"任职日期"和"离任日期"分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等 有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚 实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基 金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规,无损害基金持有人 利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时,公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,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。在交易过程中,按照"时间优先、价格优先、比例分配、平等对待"的原则,公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控,通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了 公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日 反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 17 次, 其中 16 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易,其 余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关投 资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025年第3季度,A股市场呈现稳步缓慢上升的走势。从市值规模和风格两个维度来看,本季度大小市值指数之间收益分化较小,成长和价值指数之间收益 表现差异相对较大。本季度相对于上个季度,代表整体市场活跃度的中证全指日均换手率大幅上升,但市场波动率却明显下降,整体市场表现出稳定上升的行情。

本基金的标的指数是中证上海环交所碳中和指数,该指数选取清洁能源、储能等深度低碳领域中市值较大的,以及火电、钢铁等高碳减排领域中碳减排潜力

较大的合计 100 只上市公司证券作为指数样本,以反映对碳中和贡献较大的上市公司证券的整体表现。本基金按照根据指数结构复制指数的方法投资,指数样本采用完全复制法进行投资运作,尽量降低跟踪误差。

由于中证上海环交所碳中和指数中电力设备以及与电力相关的公用事业行业股票占比较高,电力设备行业在本季度大幅跑赢整体市场,从而中证上海环交所碳中和指数本季度的表现好于整体市场。本季度中证上海环交所碳中和指数样本股票日均换手率较上个季度上升,而波动率较上个季度出现下降。日均换手率高于同期市场平均水平,表明投资者对该指数受到长期投资者的关注。

在基金投资运作方面,本基金严格遵守合同要求,认真对待投资者日常申购、 赎回及成份股调整等工作,本基金在报告期内交易和申购赎回正常,运作过程中 未发生风险事件。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为 33.00%,同期业绩比较基准收益率为 31.85%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额	话日	◇妈(干)	占基金总资产
	金额(元)	的比例(%)	
1	权益投资	374,186,036.80	96.44
	其中: 股票	374,186,036.80	96.44
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-

3	贵金属投资	-	1
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售		
	金融资产	-	1
6	银行存款和结算备付金合计	3,822,952.71	0.99
7	其他资产	9,989,866.61	2.57
8	合计	387,998,856.12	100.00

注:上表中的权益投资项含可退替代款估值增值,而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值 比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	52,185,886.32	13.84
С	制造业	260,366,041.43	69.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	50,308,156.92	13.34
Е	建筑业	6,261,411.00	1.66
F	批发和零售业	21,698.39	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	_
Н	住宿和餐饮业	-	_
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	_
J	金融业	-	_
K	房地产业	_	_
L	租赁和商务服务业	_	_
M	科学研究和技术服务业	18,256.34	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	5,024,586.40	1.33
О	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	374,186,036.80	99.23

5.2.2 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投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

					占基金资产
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	净值比例
					(%)
1	300750	宁德时代	112,832	45,358,464.00	12.03
2	601899	紫金矿业	1,443,953	42,509,976.32	11.27
3	600900	长江电力	839,083	22,865,011.75	6.06
4	002594	比亚迪	186,600	20,378,586.00	5.40
5	300274	阳光电源	100,200	16,230,396.00	4.30
6	600309	万华化学	165,100	10,992,358.00	2.92
7	300124	汇川技术	129,600	10,863,072.00	2.88
8	603993	洛阳钼业	616,300	9,675,910.00	2.57
9	300014	亿纬锂能	83,645	7,611,695.00	2.02
10	601012	隆基绿能	415,400	7,477,200.00	1.98

5.4 报告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。

- 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细本基金本报告期末未持有债券。
- 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,阳光电源股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚的情形。 5.11.2 本报告期内,本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,083.52
2	应收证券清算款	9,921,975.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	37,807.92
8	其他	-
9	合计	9,989,866.61

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	535,597,408.00
报告期期间基金总申购份额	10,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	174,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少	
以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	371,597,408.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

- (二)《广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三)《广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金托管协 议》
 - (四) 法律意见书
 - (五)基金管理人业务资格批件、营业执照
 - (六)基金托管人业务资格批件、营业执照

8.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

8.3 查阅方式

- 1.书面查阅: 投资者可在营业时间免费查阅, 也可按工本费购买复印件;
- 2.网站查阅:基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司 二〇二五年十月二十八日