

中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 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。本年度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3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。

本报告期自2022年03月22日起至2022年12月31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	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6 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	69
8.7 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	69
8.8 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	69
8.9 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	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.3 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	72
§10 开放式基金份额变动	72
§11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	73
11.2 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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	75
§12 影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1 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	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	中加低碳经济六个月持有混合	
基金主代码	014478	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年03月22日	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
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	83,078,234.66份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中加低碳经济六个月持有混合A	中加低碳经济六个月持有混合C
下属分级基金的交易代码	014478	014479
报告期末下属分级基金的份额总额	64,986,561.77份	18,091,672.89份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选低碳经济主题相关优质上市公司进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用积极的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健的收益。
业绩比较基准	中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+1年期定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

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	中加基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凌
	联系电话	400-00-95526
	电子邮箱	service@bobbs.com
客户服务电话	400-00-95526	95588
传真	010-83197627	010-66105798
注册地址	北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址	北京市西城区南纬路35号	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码	100050	100140
法定代表人	夏远洋	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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.bobbs.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	本期2022年03月22日（基金合同生效日） - 2022年12月31日	
	中加低碳经济六个月持有混合A	中加低碳经济六个月持有混合C
本期已实现收益	9,766,359.37	1,346,955.12
本期利润	9,360,575.88	-682,235.52
加权平均基金份额本期利润	0.0638	-0.0301
本期加权平均净值利润率	5.81%	-2.78%
本期基金份额净值增长率	-6.51%	-7.09%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	
期末可供分配利润	-4,233,022.58	-1,283,238.41
期末可供分配基金份额利润	-0.0651	-0.0709
期末基金资产净值	60,753,539.19	16,808,434.48
期末基金份额净值	0.9349	0.9291
3.1.3 累计期末指标	2022年末	
基金份额累计净值增长率	-6.51%	-7.09%

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、本期已实现收益是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、对期末可供分配利润，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（为期末余额，不是当期发生额）；

4、本基金基金合同于2022年3月22日生效，截至本报告期末，本基金基金合同生效未满一年。

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

中加低碳经济六个月持有混合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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	-12.04%	2.41%	3.03%	0.99%	-15.07%	1.42%
过去六个月	-18.78%	2.45%	-9.18%	0.87%	-9.60%	1.58%
自基金合同生效起至今	-6.51%	2.08%	-5.48%	0.96%	-1.03%	1.12%

中加低碳经济六个月持有混合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
过去三个月	-12.22%	2.41%	3.03%	0.99%	-15.25%	1.42%
过去六个月	-19.11%	2.45%	-9.18%	0.87%	-9.93%	1.58%
自基金合同生效起至今	-7.09%	2.08%	-5.48%	0.96%	-1.61%	1.12%

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

中加低碳经济六个月持有混合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
(2022年03月22日-2022年12月31日)



中加低碳经济六个月持有混合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

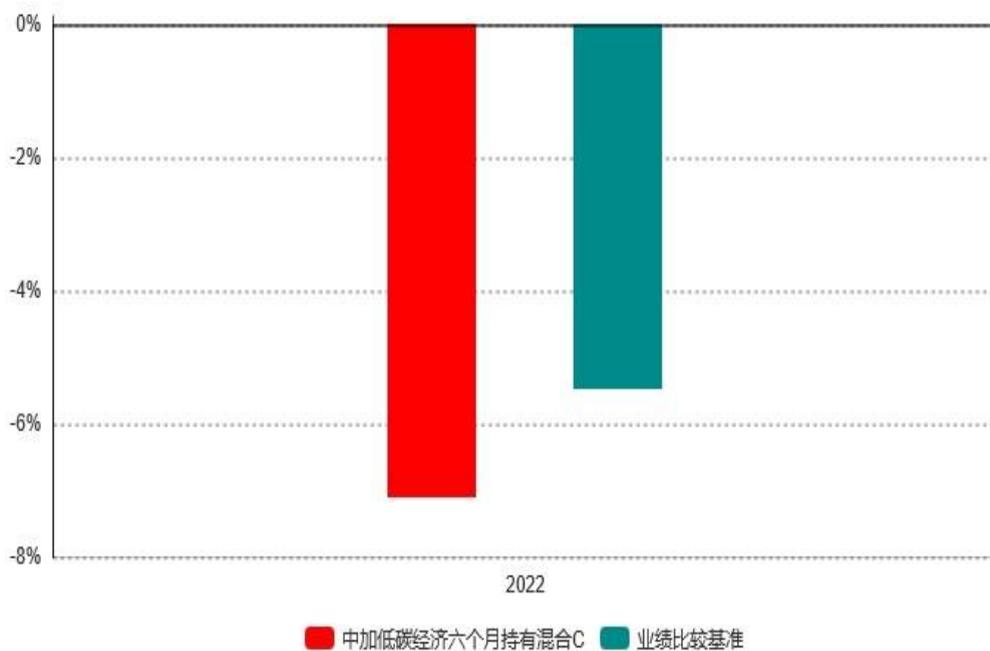
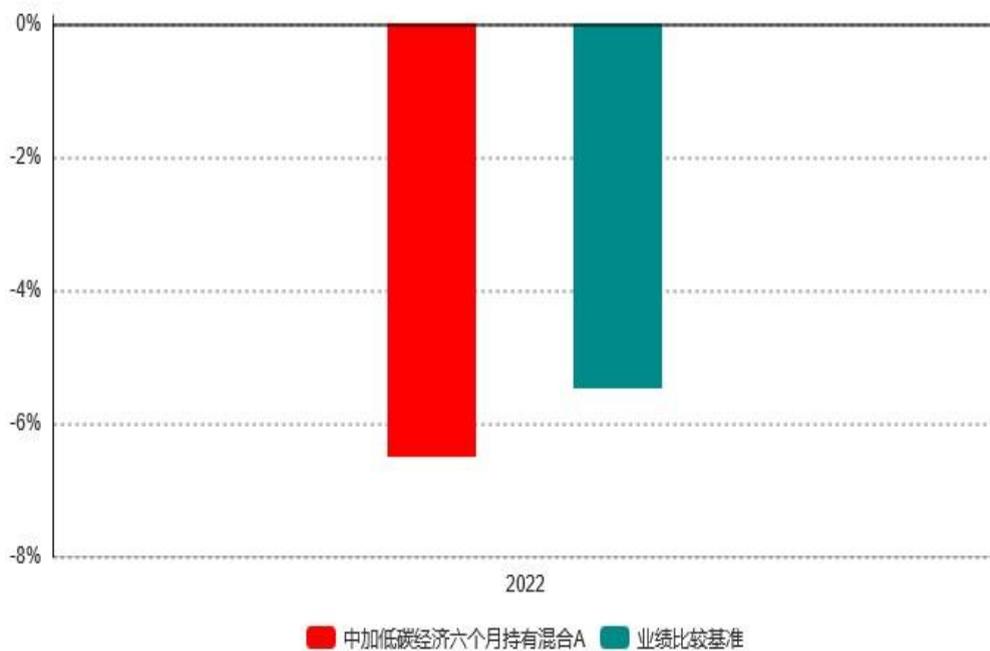
(2022年03月22日-2022年12月31日)



注：1.本基金基金合同于2022年3月22日生效，截至本报告期末，本基金基金合同生效未
满一年。

2.按基金合同规定，本基金建仓期为6个月，截至本报告期末，本基金建仓期已结束。建
仓期结束时，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

自2022年3月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日止期间，本基金未实施利润分配。

§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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、中国有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

本报告期内，本基金管理人共管理七十五只基金，分别是中加货币市场基金（A/C）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债债券型证券投资基金、中加改革红利灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加丰润纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰尚纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加丰泽纯债债券型证券投资基金、中加纯债两年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加丰享纯债债券型证券投资基金、中加丰裕纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加纯债定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加颐享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加聚鑫纯债一年定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐慧三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加心悦灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐兴定期开放债券型发起式证券投资基金、中加颐信纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加颐睿纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加转型动力灵活配置混合型证券投资基金（A/C）、中加颐合纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加颐鑫纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加聚利纯债定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加颐智纯债债券型证券投资基金、中加瑞利纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鑫纯债债券型证券投资基金、中加裕盈纯债债券型证券投资基金、中加聚盈四个月定期开放债券型证券投资基金（A/C）、中加恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金、中加颐瑾六个月定期开放债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加民丰纯债债券型证券投资基金、中加享利三年定期开放债券型证券投资基金、中加享润两年定期开放债券型证券投资基金、中加优选中高等级债券型证券投资基金（A/C）、中加科盈混合型证券投资基金（A/C）、中加优享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞享纯债债券型证券投资基金（A/C）、中加安瑞稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（A/Y）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金、中加中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、中加聚庆六个月定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加核心智造混合型证券投资基金（A/C）、中加优势企业混合型证券投资基金（A/C）、中加安瑞平衡养老目标三年持有期混合型发起式基

金中基金（FOF）、中加博裕纯债债券型证券投资基金、中加新兴成长混合型证券投资基金(A/C)、中加中证 500 指数增强型证券投资基金(A/C)、中加瑞合纯债债券型证券投资基金、中加新兴消费混合型证券投资基金（A/C）、中加穗盈纯债债券型证券投资基金、中加聚隆六个月持有期混合型证券投资基金(A/C)、中加丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加科鑫混合型证券投资基金(A/C)、中加中债-1-5 年国开行债券指数证券投资基金、中加聚优一年定期开放混合型证券投资基金（A/C）、中加消费优选混合型证券投资基金（A/C）、中加喜利回报一年持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加优悦一年定期开放债券型证券投资基金、中加科瑞混合型证券投资基金（A/C）、中加中债-1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中加邮益一年持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加龙头精选混合型证券投资基金（A/C）、中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金（A/C）、中加量化研选混合型证券投资基金（A/C）、中加恒享三个月定期开放债券型证券投资基金、中加聚享增盈债券型证券投资基金（A/C）、中加瑞鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加聚安 60 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金（A/C）、中加安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中加博盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中加中债-新综合债券指数发起式证券投资基金、中加医疗创新混合型发起式证券投资基金（A/C）、中加安瑞积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

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		
李坤元	本基金基金经理	2022-03-22	-	16	李坤元女士，南开大学金融学硕士。2006年7月至2007年5月任申银万国证券研究所分析师。2007年5月至2013年4月任信达澳银基金管理有限公司高级研究员、基金经理助理、基金经理。2013年4月至2014年10月任东方基金管理有

				<p>限责任公司基金经理。2014年10月至2019年12月任泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年12月加入中加基金管理有限公司，现任中加优势企业混合型证券投资基金（2020年8月13日至今）、中加新兴成长混合型证券投资基金（2020年9月17日至今）、中加新兴消费混合型证券投资基金（2020年12月9日至今）、中加龙头精选混合型证券投资基金（2022年2月9日至今）、中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金（2022年3月22日至今）、中加医疗创新混合型发起式证券投资基金（2022年11月30日至今）的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、任职日期说明：本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准遵从《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》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》、《中加基金管理有限公司异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定。公司通过事前控制、事中控制、事后控制的方法，保证各投资组合的公平交易，防止不同组合之间的利益输送，保护各类资产委托人的利益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

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

2022年中加低碳经济表现一般。作为主题类基金，中加低碳经济的选股思路立足于成长，主要通过寻找在低碳板块中找到业绩弹性较大，估值提升可能性较高的标的从而在该行业出现板块行机会时取得最大的上行弹性；但是而此类标的的估值波动水平也更大，在市场轮动速度加剧的背景下会放大组合整体的波动。

低碳经济在四月完成了建仓，恰逢迎来了疫情冲击后的经济恢复，在五月一系列经济增长驱动政策和俄乌战争对能源革命的催化下，新能源板块迎来一波较为陡峭的行情，其中最具代表性的就是储能板块，管理人在市场认知还不全面的时候对其进行了较为全面的研究分析，包括其独特的商业模式，回收期归因分析，竞争格局和市场空间测算，最终得出了全面做多的结论，并且在仓位上做出了较大的倾斜，最终在二季度取得了较好的业绩表现。

进入三季度，低碳板块的估值波动进一步加大，其中储能板块在经历过第一波暴力的估值提升后，边际变化趋于平缓，同时欧洲相关国家也出台了电价的管控策略，天然气期货价格也开始冲高回落，整个储能板块逐渐从基本面驱动变为情绪驱动。风电和光伏在板块表现上出现一定背离：光伏由于不断博弈硅料的降价预期，板块内部轮动加剧，但由于部分标的有业绩端的支撑，回调力度可控；风电由于二季度开工较差，相关标的表现普遍较差，板块回撤幅度较大。管理人在储能和风电上的配置权重导致了第三季度业绩的较大回撤。

第四季度新能源板块走势较弱，一方面子行业中有边际增量变化的部分如欧洲能源危机矛盾趋缓，另外整个风光储产业链本身也进入了放量不及预期的预期加强阶段，再叠加疫情精细化管理后的经济复苏预期博弈，新能源板块的资金迅速流出，本基金由于行业受限，同时认为业绩优秀的标的能在下行的周期拥有更强的安全边际，故拥抱了边际催化较弱但业绩较为优秀的资产，但事实证明，在下行的周期内，估值的坍塌比最初想象的还要快，对预期的下调才是最致命的。

总体而言，2022年对中加低碳经济来说，是前高后低的一年，上半年成功的原因是对研究的细化和对趋势的确认，下半年则是过于相信标的的业绩，小看了估值所带来的风险。2023年管理人会在确保细致研究的同时，加强对估值安全边际的探究和理解。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加低碳经济六个月持有混合A基金份额净值为0.9349元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.51%，同期业绩比较基准收益率为-5.48%；截至报告期末中加低碳经济六个月持有混合C基金份额净值为0.9291元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-7.09%，同期业绩比较基准收益率为-5.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

23年新能源进入阶段性增速高点，相关产业链业绩兑现度增高；同时产业链供给和外部环境不再成为抑制装机增长的瓶颈，主要矛盾点转向需求。这两点决定了今年的思维框架和投资逻辑需要做出相应的改变：对业绩的把握度需要更高，对估值的思考需要匹配更长的时间维度。

光伏板块来看，原先卡住整条产业链的硅料环节在23年即将迎来供需关系的扭转，这意味着下游厂商能够大幅降低自己的生产成本，同时，由于最终端的用户在满足自己的合理收益率后，对组件没有太强的压价诉求，所以整条产业链相比去年能够留住更多的利润，再叠加确定性较强的装机落地增长，最终保证了业绩的兑现度，在此基础上管理人会更加精确的把控业绩释放的节奏需：上半年由于成本端和销售端有错配，预期相关产业链的利润释放会更好，下半年可能证伪的风险点增多，同时衰退逻辑的演绎可能

加剧，故在上半年管理人会更基于业绩来指导投资，下半年则会加大对长期估值的思考，包括光伏未来的发展方向和竞争格局等，基于此寻找估值重估的可能性。

风电板块来看，22年的实际落地低预期已经反应的较为彻底，今年在22年延后项目和高招标的保证下，相关产业链进入了兑现业绩的阶段。就实地调研结果来看，相关风电产业链的开工和排产已经有了明显的提升，去年的压制因素在今年基本消除，景气度的提升有保证。管理人将在确保外部风险和行业风险可控的阶段进行配置，并且时刻关注可能影响公司业绩的风险点，选择有业绩支撑且估值端有边际变化的标的。

储能板块来看，整体行业仍处于从1到10的过程中，板块业绩的兑现优先度并不像光伏板块一样靠前，主要关注点仍然在其估值上。储能的商业模式仍然是影响其估值较为重要的点，强配和经济性驱动这两条不同的路决定了其放量过程的可控性：如果是强配，需要跟踪的就是风光的装机总量，而如果是经济性驱动，就需要对产业链格局和各省相关政策有较深的理解。现在我国各省的储能发展阶段和配套条件相差较大，管理人将继续加大对各省政策和资源禀赋的研究，寻找出增速较快且商业逻辑最通畅的相关标的。

运营商板块来看，主要关注火电标的。23年相比前几年是一个较为平稳的年份，当剔除了俄乌战争和国内转型元年的影响后，全球能源价格中枢将会有一定程度的下降，这归因于需求稳定后的供给改善。基于此，管理人认为23年火电盈利反转的确定性较强。火电作为双碳转型的奠基石，是新型电力系统不可或缺的一部分，系统重要性赋予了他稳定的估值。故总体来看，火电运营商能够较为确定的赚取业绩反转的钱。管理人将优先考虑业绩弹性大，改善能力强，系统重要性高的火电公司。

电动车板块，23年电动车依旧是为数不多的有较好增长的行业。但需要警惕的时行业的增速相比21和22年有一定的下降。这个板块绝大部分公司的商业模式属于重资产+2B，长期来看估值中枢比较低。一旦行业的增长开始降低的时候，整个行业的估值中枢会开始朝其较低的长期中枢开始调整。因此对于电动车板块，管理人会更加注重对于基本面的把握，并且对低估值的保护有额外的要求。

管理人对低碳板块在23年的表现较为乐观，相比22年其拥有更低的行业拥挤度，更高的业绩兑现可能性，但是其也需要投资者对业绩有更精准的把控度，对估值有更深入的理解，行业的投资框架需要更加精细化。管理人将继续细化研究水平，探索新技术的同时把握确定性。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规，切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，由督察长、监察稽核部门定期与不定期的对基金的投资、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或

事后的监督检查。加强合规风险的事前控制，认真履行依法监督检查职责，促进基金运作的合法合规性和风险管理水平的提高；严格事前的监督审查和控制机制，对基金募集、市场营销、受托资产的投资管理、信息披露等方面均进行事先的合法合规审查工作；在风控系统中设置投资合规参数，对投资行为进行事中监控和预警；根据业务发展情况开展专项稽核，通过事后检查的方式促使投资运作合法合规。除此之外，公司监察稽核部门对各业务部门拟定的制度规范进行合规性审核，确保业务流程的合法合规；对公司员工进行法律法规宣导并组织合规培训，增强员工合规意识并营造公司整体的合规文化氛围。

同时，基金管理人还制定了具体、严格的投资授权流程和权限；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并根据相关规定呈报中国证监会或其派出机构以及公司董事会。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组和风险内控小组。公司负责人（或其指定管理人员）任估值小组负责人，成员由固定收益部负责人、投资研究部门相关业务负责人、运营保障部门负责人、基金会计人员、投资研究相关人员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。公司分管风险管理业务的副总经理任风险内控小组负责人，成员包括风险管理部门、监察稽核部门相关人员、交易员组成（若负责人认为必要，可适当增减小组成员），主要负责对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

自2022年3月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日止期间，本基金未实施利润分配。

4.9 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

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§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，本托管人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，本基金管理人--中加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、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中加基金管理有限公司编制和披露的本基金2022年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2302386号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金(以下简称"该基金")财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,自2022年3月22日(基金合同生效日)至2022年12月31

	<p>日止期间的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则(以下简称"企业会计准则")、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金2022年12月31日的财务状况以及自2022年3月22日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称"审计准则")的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人中加基金管理有限公司(以下简称"该基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2022年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项</p>

	需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注7.4.2所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的</p>

	<p>合理性。(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	李砾、刘宇宁
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2023-03-29

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	2,381,292.68
结算备付金		155,979.99
存出保证金		113,035.51

交易性金融资产	7.4.7.2	74,208,867.50
其中：股票投资		72,284,296.08
基金投资		-
债券投资		1,924,571.42
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
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		1,609,394.82
应收股利		-
应收申购款		4,012.64
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		78,472,583.14
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		189,008.85
应付管理人报酬		98,883.23

应付托管费		16,480.55
应付销售服务费		11,369.24
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	7.4.7.6	594,867.60
负债合计		910,609.47
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	83,078,234.66
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-5,516,260.99
净资产合计		77,561,973.67
负债和净资产总计		78,472,583.14

注：1.报告截止日2022年12月31日，A类基金份额净值为0.9349元，A类基金份额总额64,986,561.77份；C类基金份额净值为0.9291元，C类基金份额总额18,091,672.89份，总份额合计83,078,234.66份。

2.本基金本年财务报表实际编制期间为2022年3月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日止。

7.2 利润表

会计主体：中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年03月22日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
一、营业总收入		11,526,309.68
1.利息收入		393,994.88
其中：存款利息收入	7.4.7.9	120,335.07
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		273,659.81
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,567,288.93
其中：股票投资收益	7.4.7.10	12,785,212.09
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	22,958.01
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	759,118.83
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）	7.4.7.16	-2,434,974.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
减：二、营业总支出		2,847,969.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,157,205.77
2. 托管费	7.4.10.2.2	359,534.30
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	152,348.37
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	7.4.7.18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.19	178,880.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,678,340.36
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,678,340.36
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		8,678,340.36

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31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）	210,031,269.87	-	-	210,031,269.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-126,953,035.21	-	-5,516,260.99	-132,469,296.20
（一）、综合收益总额	-	-	8,678,340.36	8,678,340.36
（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）	-126,953,035.21	-	-14,194,601.35	-141,147,636.56
其中：1.基金申	6,460,065.44	-	895,960.11	7,356,025.55

购款				
2.基金 赎回款	-133,413,100.65	-	-15,090,561.46	-148,503,662.11
(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)	83,078,234.66	-	-5,516,260.99	77,561,973.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

夏远洋

陈昕

陈昕

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2021年11月17日证监许可[2021]3674号《关于准予中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中加基金管理有限公司(以下简称“中加基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)公开募集。本基金为契约型开放式混合型证券投资基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

本基金通过中加基金直销中心、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司及北京度小满基金销售有限公司等其他销售机构公开发售,募集期为2022年2月23日起至2022年3月18日。本基金于2022年3月22日成立,成立之日基金实

收份额为210,031,269.87份(含利息转份额61,554.93份),发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的基金合同和《中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容,本基金根据认购/申购费、销售服务费的收取方式不同,将基金份额分为不同的类别。认购/申购时收取认购/申购费,不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;认购/申购时不收取认购/申购费,从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于两类份额的收费方式不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含主板、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)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、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、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况、自2022年3月22日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。本期财务报表是本基金的首份财务报表，实际编制期间为自2022年3月22日(基金合同生效日)至2022年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等。

本基金通常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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本

基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

2.金融负债的分类

本基金将金融负债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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债 (含属于金融负债的衍生工具) 和指定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

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

1.金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

2.金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失 (包括利息和股利收入) 计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失 (包括利息费用) 计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

3.金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金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；

- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

4.金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内(若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

1. 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
2. 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动（包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额）形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配。每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；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对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；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各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；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供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除

外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中债金融估值中心有限公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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 [2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税 [2014] 81号文《财政部国家税务总局证监会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》、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》、上证交字 [2008] 16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36号文《财政部、国家税务总局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》、财税 [2017] 2号文《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》、中投信 [2021] 20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、

财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号《财政部、国家税务总局、中国证券监督管理委员会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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

1、对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

2、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(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018年1月1日(含)以后，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，以管理人为增值税纳税人，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日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

3、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

4、对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收

入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按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。

对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。

内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。个人投资者在国外已缴纳的预提税，可持有效扣税凭证到中国结算的主管税务机关申请税收抵免。

对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，计入其收入总额，依法计征企业所得税。其中，内地居民企业连续持有H股满12个月取得的股息红利所得，依法免征企业所得税。

5、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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

根据香港联合交易所有限公司（以下简称联交所）上调股票交易印花税公告，自2021年8月1日起，香港市场的股票交易印花税由按成交金额的0.1%双向收取，上调为按成交金额的0.13%双向收取（取整到元，不足一元按一元计）。按照《上海证券交易所沪港通业务实施办法》第七十六条的有关规定，投资者进行沪港通下的港股通交易，应按照联交所市场的有关规定交纳相关费用。

6、对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，自2019年12月5日起至2022年12月31日止，继续暂免征收个人所得税。对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，计入其收入总额，依法征收企业所得税。

7、对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日

活期存款	2,381,292.68
等于：本金	2,380,882.25
加：应计利息	410.43
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	2,381,292.68

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	74,713,912.21	-	72,284,296.08	-2,429,616.13	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,907,448.00	22,481.42	1,924,571.42	-5,358.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,907,448.00	22,481.42	1,924,571.42	-5,358.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	76,621,360.21	22,481.42	74,208,867.50	-2,434,974.13
----	---------------	-----------	---------------	---------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	425,367.60
其中：交易所市场	425,367.60
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-账户维护费	4,500.00
预提费用-审计费	65,000.00
预提费用-信息披露费	100,000.00
合计	594,867.60

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 中加低碳经济六个月持有混合A

金额单位：人民币元

项目 (中加低碳经济六个月持有混合A)	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	185,460,906.34	185,460,906.34
本期申购	4,596,808.41	4,596,808.41
本期赎回（以“-”号填列）	-125,071,152.98	-125,071,152.98
本期末	64,986,561.77	64,986,561.77

7.4.7.7.2 中加低碳经济六个月持有混合C

金额单位：人民币元

项目 (中加低碳经济六个月持有混合C)	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	24,570,363.53	24,570,363.53
本期申购	1,863,257.03	1,863,257.03
本期赎回（以“-”号填列）	-8,341,947.67	-8,341,947.67
本期末	18,091,672.89	18,091,672.89

注：赎回含转换出份（金）额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 中加低碳经济六个月持有混合A

单位：人民币元

项目 (中加低碳经济六个月持有混合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	9,766,359.37	-405,783.49	9,360,575.88
本期基金份额交易产生的变动数	-5,196,072.11	-8,397,526.35	-13,593,598.46

其中：基金申购款	203,687.86	412,912.53	616,600.39
基金赎回款	-5,399,759.97	-8,810,438.88	-14,210,198.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,570,287.26	-8,803,309.84	-4,233,022.58

7.4.7.8.2 中加低碳经济六个月持有混合C

单位：人民币元

项目 (中加低碳经济六个月 持有混合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	1,346,955.12	-2,029,190.64	-682,235.52
本期基金份额交易产生的变动数	-198,545.34	-402,457.55	-601,002.89
其中：基金申购款	71,864.49	207,495.23	279,359.72
基金赎回款	-270,409.83	-609,952.78	-880,362.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,148,409.78	-2,431,648.19	-1,283,238.41

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	91,397.32
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	24,246.73
其他	4,691.02
合计	120,335.07

注：本报告期内其他为存出保证金利息收入和申购款利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	639,424,452.01
减：卖出股票成本总额	624,901,685.83
减：交易费用	1,737,554.09
买卖股票差价收入	12,785,212.09

7.4.7.11 债券投资收益**7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	28,935.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,977.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	22,958.01

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,026,360.00

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,905,977.00
减：应计利息总额	126,360.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-5,977.00

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券申购差价收入。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	759,118.83
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	759,118.83
----	------------

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-2,434,974.13
——股票投资	-2,429,616.13
——债券投资	-5,358.00
——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	-2,434,974.13

7.4.7.17 其他收入

本基金在本报告期无其他收入。

7.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	65,000.00

信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,880.88
账户维护费	12,000.00
合计	178,880.88

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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
中加基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
北银丰业资产管理有限公司	基金管理人控股的子公司
中加国际资产管理有限公司	基金管理人控股的子公司
The Bank of Nova Scotia	基金管理人的股东
中国有研科技集团有限公司	基金管理人的股东
北京乾融投资（集团）有限公司	基金管理人的股东
中地种业（集团）有限公司	基金管理人的股东
绍兴越华开发经营有限公司	基金管理人的股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金在本报告期没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,157,205.77
其中：支付销售机构的客户维护费	725,863.13

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
----	--

当期发生的基金应支付的托管费	359,534.30
----------------	------------

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。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。

7.4.10.2.3 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 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加低碳经济六个月持有混合A	中加低碳经济六个月持有混合C	合计
中加基金管理有限公司	0.00	86,885.84	86,885.84
北京银行股份有限公司	0.00	5,523.60	5,523.60
中国工商银行股份有限公司	0.00	19,877.46	19,877.46
合计	0.00	112,286.90	112,286.90

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值的0.80%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C类基金份额销售服务费=前一日C类份额基金资产净值×0.80%/当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金在本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

况
无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中加低碳经济六个月持有混合A

份额单位：份

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金合同生效日（2022年03月22日）持有的基金份额	20,000,000.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	20,000,000.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

中加低碳经济六个月持有混合C

份额单位：份

项目	本期 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金合同生效日（2022年03月22日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

7.4.10.5.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 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 2022年03月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,381,292.68	91,397.32

注：本基金的活期存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计提。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与各关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

于2022年12月31日，本基金未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2022年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

于2022年12月31日，本基金未持有因银行间债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2022年12月31日，本基金未持有因交易所债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2022年12月31日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、监察稽核部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要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，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的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范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指本基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人和信用风险较低的商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人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进行限制以控制相应的信用风险；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。

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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日
AAA	-
AAA以下	-
未评级	1,924,571.42
合计	1,924,571.42

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融资工具。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

4.本基金于2022年3月22日成立，无去年同期数据。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。

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独立的风险管理部门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。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，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。

于本报告期末，本基金承担的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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，除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7.4.12（如有）外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。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。

报告期内，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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年1 2月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,381,292.68	-	-	-	2,381,292.68

结算备付金	55,979.99	-	-	100,000.00	155,979.99
存出保证金	113,035.51	-	-	-	113,035.51
交易性金融资产	1,924,571.42	-	-	72,284,296.08	74,208,867.50
应收清算款	-	-	-	1,609,394.82	1,609,394.82
应收申购款	-	-	-	4,012.64	4,012.64
资产总计	4,474,879.60	-	-	73,997,703.54	78,472,583.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	189,008.85	189,008.85
应付管理人报酬	-	-	-	98,883.23	98,883.23
应付托管费	-	-	-	16,480.55	16,480.55
应付销售服务费	-	-	-	11,369.24	11,369.24
其他负债	-	-	-	594,867.60	594,867.60
负债总计	-	-	-	910,609.47	910,609.47
利率敏感度缺口	4,474,879.60	-	-	73,087,094.07	77,561,973.67

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。本基金于2022年3月22日成立，无去年同期数据。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有的交易性债券投资和资产支持证券投资金额占比不重大，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	72,284,296.08	93.20
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,924,571.42	2.48
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	74,208,867.50	95.68

本基金于2022年3月22日成立，无去年同期数据。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2022年12月31日
第一层次	72,284,296.08
第二层次	1,924,571.42
第三层次	-
合计	74,208,867.50

7.4.14.2.2 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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2022年12月31日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	72,284,296.08	92.11
	其中：股票	72,284,296.08	92.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,924,571.42	2.45
	其中：债券	1,924,571.42	2.45
	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	2,537,272.67	3.23
8	其他各项资产	1,726,442.97	2.20
9	合计	78,472,583.14	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	70,792,387.28	91.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

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	1,491,908.80	1.92
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	72,284,296.08	93.20

8.2.2 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港股通股票。

8.3 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	300274	阳光电源	69,100	7,725,380.00	9.96
2	605117	德业股份	19,080	6,319,296.00	8.15
3	603606	东方电缆	67,300	4,564,959.00	5.89
4	300438	鹏辉能源	55,800	4,351,842.00	5.61
5	300014	亿纬锂能	48,900	4,298,310.00	5.54
6	002335	科华数据	63,300	3,158,037.00	4.07
7	301155	海力风电	32,200	2,812,670.00	3.63
8	603806	福斯特	41,300	2,743,972.00	3.54
9	688063	派能科技	8,641	2,727,531.65	3.52
10	002459	晶澳科技	45,300	2,722,077.00	3.51
11	002487	大金重工	64,000	2,647,680.00	3.41
12	002837	英维克	77,400	2,578,194.00	3.32

13	688223	晶科能源	160,901	2,357,199.65	3.04
14	002121	科陆电子	213,100	1,977,568.00	2.55
15	002518	科士达	33,400	1,923,840.00	2.48
16	605286	同力日升	44,900	1,888,943.00	2.44
17	600522	中天科技	115,200	1,860,480.00	2.40
18	300827	上能电气	30,200	1,776,968.00	2.29
19	002865	钧达股份	9,100	1,684,410.00	2.17
20	300990	同飞股份	18,200	1,672,216.00	2.16
21	688248	南网科技	26,128	1,491,908.80	1.92
22	300763	锦浪科技	6,914	1,244,865.70	1.60
23	688663	新风光	27,263	1,199,572.00	1.55
24	688676	金盘科技	25,664	928,523.52	1.20
25	001269	欧晶科技	8,600	853,464.00	1.10
26	301266	宇邦新材	10,900	824,040.00	1.06
27	600487	亨通光电	53,600	807,216.00	1.04
28	300693	盛弘股份	14,700	797,916.00	1.03
29	002531	天顺风能	51,100	773,143.00	1.00
30	300750	宁德时代	1,900	747,498.00	0.96
31	688560	明冠新材	14,438	668,479.40	0.86
32	688271	联影医疗	882	156,096.36	0.20

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300438	鹏辉能源	12,191,133.00	15.72
2	688063	派能科技	11,673,639.60	15.05
3	605117	德业股份	11,257,061.00	14.51
4	688223	晶科能源	10,671,885.17	13.76
5	003022	联泓新科	10,316,455.00	13.30

6	002487	大金重工	8,307,569.00	10.71
7	600875	东方电气	7,878,806.47	10.16
8	688599	天合光能	7,730,973.29	9.97
9	301327	华宝新能	7,557,912.65	9.74
10	002850	科达利	7,494,022.00	9.66
11	300014	亿纬锂能	7,118,837.00	9.18
12	002738	中矿资源	7,020,500.64	9.05
13	688390	固德威	7,001,694.91	9.03
14	300274	阳光电源	6,968,969.00	8.99
15	300693	盛弘股份	6,522,724.00	8.41
16	002466	天齐锂业	6,463,676.28	8.33
17	600256	广汇能源	6,416,346.00	8.27
18	000001	平安银行	6,366,744.00	8.21
19	002865	钧达股份	6,331,662.00	8.16
20	300850	新强联	6,241,249.10	8.05
21	002459	晶澳科技	6,222,321.30	8.02
22	002245	蔚蓝锂芯	6,182,124.00	7.97
23	600519	贵州茅台	6,041,744.00	7.79
24	603606	东方电缆	6,033,918.00	7.78
25	600011	华能国际	5,992,067.62	7.73
26	002531	天顺风能	5,901,269.00	7.61
27	600522	中天科技	5,824,495.00	7.51
28	301155	海力风电	5,746,440.00	7.41
29	300763	锦浪科技	5,741,968.40	7.40
30	002517	恺英网络	5,704,102.00	7.35
31	601012	隆基绿能	5,570,440.80	7.18
32	000810	创维数字	5,405,005.00	6.97
33	000625	长安汽车	5,377,700.00	6.93
34	688248	南网科技	5,333,807.31	6.88
35	600795	国电电力	5,227,343.04	6.74
36	688819	天能股份	5,196,849.82	6.70

37	688259	创耀科技	5,196,364.03	6.70
38	688072	拓荆科技	5,086,408.30	6.56
39	000657	中钨高新	5,030,093.00	6.49
40	300750	宁德时代	4,998,533.00	6.44
41	603568	伟明环保	4,987,541.20	6.43
42	688032	禾迈股份	4,977,992.32	6.42
43	601689	拓普集团	4,967,707.50	6.40
44	601238	广汽集团	4,966,400.20	6.40
45	601702	华峰铝业	4,962,734.00	6.40
46	600600	青岛啤酒	4,850,654.00	6.25
47	000799	酒鬼酒	4,796,334.00	6.18
48	002074	国轩高科	4,668,315.00	6.02
49	002121	科陆电子	4,658,807.00	6.01
50	002176	江特电机	4,628,762.00	5.97
51	600132	重庆啤酒	4,609,019.00	5.94
52	600096	云天化	4,584,134.00	5.91
53	603799	华友钴业	4,533,175.00	5.84
54	688348	昱能科技	4,480,161.82	5.78
55	300776	帝尔激光	4,479,100.40	5.77
56	301312	智立方	4,423,632.00	5.70
57	002756	永兴材料	4,365,033.00	5.63
58	600089	特变电工	4,316,642.37	5.57
59	002304	洋河股份	4,232,490.00	5.46
60	000729	燕京啤酒	4,209,151.00	5.43
61	000895	双汇发展	4,203,800.00	5.42
62	601668	中国建筑	4,202,135.00	5.42
63	601658	邮储银行	4,201,900.00	5.42
64	601166	兴业银行	4,198,550.00	5.41
65	000568	泸州老窖	4,171,597.00	5.38
66	600933	爱柯迪	3,761,553.00	4.85
67	601126	四方股份	3,549,845.00	4.58

68	600487	亨通光电	3,470,125.00	4.47
69	600197	伊力特	3,400,289.00	4.38
70	000596	古井贡酒	3,321,209.00	4.28
71	603800	道森股份	3,250,059.00	4.19
72	300658	延江股份	3,154,364.50	4.07
73	600549	厦门钨业	3,127,092.00	4.03
74	000035	中国天楹	3,096,816.00	3.99
75	002876	三利谱	3,004,615.20	3.87
76	002837	英维克	2,915,481.20	3.76
77	605286	同力日升	2,868,216.00	3.70
78	002851	麦格米特	2,752,416.00	3.55
79	002335	科华数据	2,742,326.00	3.54
80	603936	博敏电子	2,733,533.00	3.52
81	603197	保隆科技	2,729,114.00	3.52
82	603806	福斯特	2,722,451.00	3.51
83	002745	木林森	2,721,034.00	3.51
84	688680	海优新材	2,652,014.01	3.42
85	300681	英搏尔	2,649,353.00	3.42
86	300125	聆达股份	2,608,073.89	3.36
87	301193	家联科技	2,605,413.00	3.36
88	300666	江丰电子	2,594,567.15	3.35
89	603051	鹿山新材	2,588,208.00	3.34
90	2380	中国电力	2,560,498.86	3.30
91	002192	融捷股份	2,546,677.00	3.28
92	300978	东箭科技	2,534,532.00	3.27
93	301021	英诺激光	2,514,374.00	3.24
94	600888	新疆众和	2,505,483.19	3.23
95	002182	云海金属	2,504,270.00	3.23
96	601222	林洋能源	2,502,818.00	3.23
97	002405	四维图新	2,502,398.00	3.23
98	300565	科信技术	2,494,732.00	3.22

99	300443	金雷股份	2,493,051.00	3.21
100	600884	杉杉股份	2,476,840.00	3.19
101	688349	三一重能	2,447,416.79	3.16
102	002943	宇晶股份	2,447,229.00	3.16
103	603985	恒润股份	2,444,904.90	3.15
104	300068	南都电源	2,439,709.00	3.15
105	300428	立中集团	2,438,298.00	3.14
106	688667	菱电电控	2,410,528.05	3.11
107	002126	银轮股份	2,410,364.00	3.11
108	300337	银邦股份	2,410,027.00	3.11
109	300093	金刚光伏	2,409,220.00	3.11
110	300602	飞荣达	2,408,315.70	3.11
111	603659	璞泰来	2,406,055.00	3.10
112	300724	捷佳伟创	2,404,962.00	3.10
113	300373	扬杰科技	2,377,244.00	3.06
114	000707	双环科技	2,336,347.64	3.01
115	688345	博力威	2,313,567.25	2.98
116	301162	国能日新	2,293,036.00	2.96
117	300803	指南针	2,292,958.00	2.96
118	002068	黑猫股份	2,290,773.50	2.95
119	002132	恒星科技	2,286,957.00	2.95
120	000822	山东海化	2,250,620.00	2.90
121	002539	云图控股	2,250,003.00	2.90
122	600989	宝丰能源	2,249,543.26	2.90
123	600141	兴发集团	2,247,956.00	2.90
124	000731	四川美丰	2,247,184.68	2.90
125	603688	石英股份	2,224,321.00	2.87
126	601975	招商南油	2,220,577.00	2.86
127	002594	比亚迪	2,220,414.00	2.86
128	603612	索通发展	2,220,270.00	2.86
129	600438	通威股份	2,218,935.00	2.86

130	002039	黔源电力	2,218,327.00	2.86
131	603938	三孚股份	2,215,908.00	2.86
132	603032	德新科技	2,212,365.00	2.85
133	301177	迪阿股份	2,176,628.00	2.81
134	300976	达瑞电子	2,174,362.20	2.80
135	002867	周大生	2,173,259.00	2.80
136	300919	中伟股份	2,171,043.00	2.80
137	600702	舍得酒业	2,166,961.00	2.79
138	300496	中科创达	2,166,746.00	2.79
139	603218	日月股份	2,166,666.00	2.79
140	600079	人福医药	2,136,785.00	2.75
141	000858	五粮液	2,136,060.00	2.75
142	000792	盐湖股份	2,133,060.00	2.75
143	300973	立高食品	2,126,762.00	2.74
144	000519	中兵红箭	2,118,315.00	2.73
145	002056	横店东磁	2,114,368.00	2.73
146	600809	山西汾酒	2,101,138.00	2.71
147	600926	杭州银行	2,099,876.40	2.71
148	002966	苏州银行	2,098,902.00	2.71
149	600919	江苏银行	2,098,644.00	2.71
150	601838	成都银行	2,098,558.00	2.71
151	601128	常熟银行	2,098,362.46	2.71
152	601009	南京银行	2,095,884.40	2.70
153	600863	内蒙华电	2,091,140.00	2.70
154	601888	中国中免	2,089,468.00	2.69
155	600754	锦江酒店	2,086,621.03	2.69
156	002314	南山控股	2,077,787.00	2.68
157	300733	西菱动力	2,067,691.00	2.67
158	000301	东方盛虹	2,063,755.00	2.66
159	1024	快手—W	2,058,328.34	2.65
160	3690	美团—W	2,054,707.64	2.65

161	300990	同飞股份	2,052,524.00	2.65
162	688439	振华风光	1,944,923.80	2.51
163	688560	明冠新材	1,933,546.95	2.49
164	301101	明月镜片	1,896,301.00	2.44
165	300827	上能电气	1,842,527.00	2.38
166	002518	科士达	1,813,323.00	2.34
167	300957	贝泰妮	1,683,530.00	2.17
168	600233	圆通速递	1,680,073.00	2.17
169	600258	首旅酒店	1,671,887.00	2.16
170	002920	德赛西威	1,658,727.00	2.14
171	600063	皖维高新	1,640,803.00	2.12
172	600309	万华化学	1,618,550.00	2.09
173	688041	海光信息	1,589,866.02	2.05

8.4.2 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	688063	派能科技	11,248,995.51	14.50
2	688390	固德威	9,994,761.98	12.89
3	688348	昱能科技	8,775,619.15	11.31
4	600875	东方电气	8,505,981.00	10.97
5	688223	晶科能源	8,210,833.48	10.59
6	003022	联泓新科	8,130,289.00	10.48
7	002738	中矿资源	7,731,419.20	9.97
8	300438	鹏辉能源	7,580,770.00	9.77
9	601702	华峰铝业	7,459,546.00	9.62
10	000625	长安汽车	7,439,950.15	9.59
11	301327	华宝新能	7,098,109.68	9.15
12	688599	天合光能	7,084,627.54	9.13
13	600256	广汇能源	6,796,457.00	8.76

14	002466	天齐锂业	6,770,531.00	8.73
15	300763	锦浪科技	6,401,033.00	8.25
16	002850	科达利	6,351,945.00	8.19
17	600519	贵州茅台	6,288,534.00	8.11
18	000001	平安银行	6,075,577.80	7.83
19	300693	盛弘股份	6,058,277.00	7.81
20	601689	拓普集团	5,788,468.00	7.46
21	000799	酒鬼酒	5,779,109.00	7.45
22	688032	禾迈股份	5,669,357.12	7.31
23	601012	隆基绿能	5,561,063.60	7.17
24	300850	新强联	5,400,806.30	6.96
25	002245	蔚蓝锂芯	5,399,290.00	6.96
26	605117	德业股份	5,366,468.00	6.92
27	002865	钧达股份	5,350,628.00	6.90
28	688819	天能股份	5,300,341.10	6.83
29	600011	华能国际	5,237,633.00	6.75
30	002517	恺英网络	5,177,950.00	6.68
31	002487	大金重工	5,175,853.00	6.67
32	600600	青岛啤酒	5,078,710.00	6.55
33	601238	广汽集团	4,994,309.00	6.44
34	300776	帝尔激光	4,993,200.96	6.44
35	688072	拓荆科技	4,925,564.31	6.35
36	600096	云天化	4,917,855.00	6.34
37	000729	燕京啤酒	4,890,820.00	6.31
38	600795	国电电力	4,819,209.00	6.21
39	600089	特变电工	4,703,624.00	6.06
40	000810	创维数字	4,674,192.00	6.03
41	002756	永兴材料	4,499,702.00	5.80
42	002176	江特电机	4,480,323.00	5.78
43	000895	双汇发展	4,452,131.00	5.74
44	002531	天顺风能	4,451,712.00	5.74

45	000657	中钨高新	4,443,444.00	5.73
46	603568	伟明环保	4,406,831.28	5.68
47	300565	科信技术	4,392,087.00	5.66
48	002304	洋河股份	4,342,901.00	5.60
49	000568	泸州老窖	4,301,704.00	5.55
50	603799	华友钴业	4,301,197.00	5.55
51	601668	中国建筑	4,168,640.00	5.37
52	688259	创耀科技	4,163,350.76	5.37
53	600132	重庆啤酒	4,124,993.00	5.32
54	000596	古井贡酒	4,077,500.00	5.26
55	601166	兴业银行	4,073,516.00	5.25
56	300750	宁德时代	4,062,849.00	5.24
57	601658	邮储银行	4,054,992.00	5.23
58	002074	国轩高科	4,023,576.64	5.19
59	688248	南网科技	3,965,152.10	5.11
60	300068	南都电源	3,844,701.66	4.96
61	600197	伊力特	3,842,780.00	4.95
62	601126	四方股份	3,807,551.44	4.91
63	600933	爱柯迪	3,589,882.00	4.63
64	301021	英诺激光	3,467,857.00	4.47
65	002459	晶澳科技	3,397,408.95	4.38
66	301312	智立方	3,352,376.00	4.32
67	300658	延江股份	3,351,047.00	4.32
68	603688	石英股份	3,342,158.00	4.31
69	600549	厦门钨业	3,254,651.00	4.20
70	002851	麦格米特	3,137,318.00	4.04
71	300724	捷佳伟创	3,037,513.00	3.92
72	300125	聆达股份	2,975,060.00	3.84
73	603800	道森股份	2,965,825.00	3.82
74	603612	索通发展	2,861,970.00	3.69
75	002192	融捷股份	2,859,142.00	3.69

76	300428	立中集团	2,819,418.00	3.64
77	002056	横店东磁	2,646,791.00	3.41
78	300337	银邦股份	2,641,325.00	3.41
79	002405	四维图新	2,639,718.00	3.40
80	002132	恒星科技	2,617,653.00	3.37
81	601222	林洋能源	2,606,328.52	3.36
82	300014	亿纬锂能	2,589,707.00	3.34
83	300093	金刚光伏	2,576,558.00	3.32
84	000035	中国天楹	2,554,310.00	3.29
85	1024	快手-W	2,527,650.10	3.26
86	000519	中兵红箭	2,523,267.00	3.25
87	002920	德赛西威	2,517,024.00	3.25
88	300919	中伟股份	2,512,805.00	3.24
89	002745	木林森	2,508,317.00	3.23
90	002126	银轮股份	2,487,714.00	3.21
91	300602	飞荣达	2,484,901.80	3.20
92	688345	博力威	2,478,081.36	3.19
93	601975	招商南油	2,475,830.00	3.19
94	002182	云海金属	2,463,460.00	3.18
95	603659	璞泰来	2,445,534.76	3.15
96	600487	亨通光电	2,429,570.00	3.13
97	600522	中天科技	2,428,656.00	3.13
98	600438	通威股份	2,399,702.00	3.09
99	300496	中科创达	2,398,479.00	3.09
100	300373	扬杰科技	2,394,648.00	3.09
101	002876	三利谱	2,391,746.00	3.08
102	600702	舍得酒业	2,364,214.00	3.05
103	600888	新疆众和	2,359,055.00	3.04
104	603051	鹿山新材	2,348,406.00	3.03
105	600141	兴发集团	2,346,825.00	3.03
106	600884	杉杉股份	2,332,324.00	3.01

107	002039	黔源电力	2,322,166.00	2.99
108	002314	南山控股	2,314,300.00	2.98
109	600863	内蒙华电	2,312,219.13	2.98
110	300666	江丰电子	2,300,615.00	2.97
111	603938	三孚股份	2,284,229.20	2.95
112	002068	黑猫股份	2,266,957.50	2.92
113	002121	科陆电子	2,250,267.00	2.90
114	301193	家联科技	2,247,078.00	2.90
115	000707	双环科技	2,245,344.00	2.89
116	300973	立高食品	2,214,656.00	2.86
117	300803	指南针	2,205,593.00	2.84
118	688680	海优新材	2,199,327.43	2.84
119	000858	五粮液	2,195,977.00	2.83
120	3690	美团-W	2,184,730.07	2.82
121	300978	东箭科技	2,173,165.00	2.80
122	601009	南京银行	2,151,628.00	2.77
123	600809	山西汾酒	2,145,344.00	2.77
124	301162	国能日新	2,143,355.00	2.76
125	000731	四川美丰	2,141,288.00	2.76
126	688667	菱电电控	2,138,748.09	2.76
127	301155	海力风电	2,137,665.00	2.76
128	301177	迪阿股份	2,135,139.60	2.75
129	603218	日月股份	2,134,413.00	2.75
130	300443	金雷股份	2,126,877.00	2.74
131	603936	博敏电子	2,121,474.00	2.74
132	2380	中国电力	2,113,695.25	2.73
133	688439	振华风光	2,100,680.19	2.71
134	000792	盐湖股份	2,091,543.00	2.70
135	600989	宝丰能源	2,082,830.00	2.69
136	600919	江苏银行	2,082,508.00	2.68
137	300733	西菱动力	2,072,093.00	2.67

138	601838	成都银行	2,067,474.00	2.67
139	600926	杭州银行	2,060,176.00	2.66
140	002966	苏州银行	2,055,544.00	2.65
141	002867	周大生	2,048,891.00	2.64
142	300681	英搏尔	2,045,253.00	2.64
143	002539	云图控股	2,042,975.00	2.63
144	601128	常熟银行	2,030,586.00	2.62
145	002943	宇晶股份	2,024,117.00	2.61
146	603348	文灿股份	2,016,658.00	2.60
147	000822	山东海化	2,001,729.00	2.58
148	600754	锦江酒店	1,999,765.00	2.58
149	601888	中国中免	1,997,294.00	2.58
150	603197	保隆科技	1,996,800.00	2.57
151	603032	德新科技	1,977,255.00	2.55
152	688349	三一重能	1,975,245.18	2.55
153	301101	明月镜片	1,966,064.00	2.53
154	600079	人福医药	1,960,898.00	2.53
155	600348	华阳股份	1,955,604.00	2.52
156	688041	海光信息	1,928,434.33	2.49
157	603985	恒润股份	1,916,800.00	2.47
158	002594	比亚迪	1,893,989.00	2.44
159	300957	贝泰妮	1,777,698.60	2.29
160	600233	圆通速递	1,754,057.00	2.26
161	688533	上声电子	1,663,558.15	2.14
162	000301	东方盛虹	1,657,576.00	2.14
163	600309	万华化学	1,635,176.00	2.11
164	002324	普利特	1,552,026.00	2.00

8.4.3 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	699,615,598.04
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	639,424,452.01
--------------	----------------

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照成交单价乘以成交数量填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,924,571.42	2.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,924,571.42	2.48

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019638	20国债09	19,000	1,924,571.42	2.48

8.7 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。

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	113,035.51
2	应收清算款	1,609,394.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,012.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,726,442.97

8.12.4 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。

8.12.5 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未存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
中加 低碳 经济 六个 月持 有混 合A	1,7 51	37,113.97	0.00	0.00%	64,986,561.77	100.0 0%
中加 低碳 经济 六个 月持 有混 合C	381	47,484.71	13,000,000.00	71.8 6%	5,091,672.89	28.14%
合计	2,1 32	38,967.28	13,000,000.00	15.6 5%	70,078,234.66	84.35%

9.2 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	中加低碳经济六个月 持有混合A	499,591.67	0.77%
	中加低碳经济六个月	92.61	0.00%

	持有混合C		
	合计	499,684.28	0.60%

9.3 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	中加低碳经济六个月持有混合A	10~50
	中加低碳经济六个月持有混合C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中加低碳经济六个月持有混合A	-
	中加低碳经济六个月持有混合C	-
	合计	-

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	中加低碳经济六个月持有混合A	中加低碳经济六个月持有混合C
基金合同生效日(2022年03月22日)基金份额总额	185,460,906.34	24,570,363.53
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,596,808.41	1,863,257.03
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	125,071,152.98	8,341,947.67
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	64,986,561.77	18,091,672.89

注：总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

基金管理人本报告期内人事变动情况：本报告期基金管理人无重大人事变动。

基金托管人本报告期内人事变动情况：本报告期基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。本报告期内应支付审计费【65,000.00】元。

11.6 管理人、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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	336,134,344.11	25.10%	245,814.66	25.08%	-
方正证券	2	152,197,274.13	11.37%	112,227.30	11.45%	-
国信证券	2	359,461,137.20	26.84%	262,873.12	26.82%	-

首创证券	2	437,210,605.42	32.65%	319,731.61	32.62%	-
中国国际金融	2	54,036,689.19	4.04%	39,517.60	4.03%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- (1) 基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- (2) 公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- (3) 研究服务实力。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

- (1) 投资研究部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；
- (2) 公司执行委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；
- (3) 券商名单及相应的席位租用安排确定后，由监察稽核门部负责审查相关协议内容，交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3.投资研究部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估，拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排，并报公司执行委员会审批、确定。

11.7.2 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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	4,708,203.00	60.26%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	1,655,512,000.00	67.11%	-	-	-	-
国信证券	-	-	44,922,000.00	1.82%	-	-	-	-
首创证券	3,105,222.00	39.74%	766,336,000.00	31.07%	-	-	-	-
中国国际金融	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-14
2	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-14
3	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-14
4	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-14
5	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-14
6	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-14
7	关于中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金延长募集期的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-07
8	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-23
9	关于中加基金旗下部分基金在销售机构开通基金定投业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-17
10	中加基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-17

	销售（深圳）有限公司为销售机构、开通基金定期定额投资...		
11	关于中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金2022年主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换等业务...	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-17
12	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、转换转入业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-17
13	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金2022年第二季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-20
14	中加基金管理有限公司关于在中国工商银行股份有限公司开通部分基金定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-27
15	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金2022年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-08-30
16	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金开放日常赎回、转换转出业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-09-20
17	中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金2022年第三季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-10-26

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加低碳经济六个月持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.2 存放地点

基金管理人处

13.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司
二〇二三年三月三十日