

富达基金可持续信息速递

富达低碳成长基金

风险提示：本材料内容由基金管理人根据公募基金、上市公司已披露的公开信息和管理人计算的数据汇总统计得出。材料内容供投资者参考，不代表基金管理人的任何承诺和保证。

1. 投资策略

为顺应全球低碳转型趋势，在碳达峰、碳中和“1+N”国家战略指导下，富达低碳成长基金将主要投资于低碳转型相关领域，以投资推进绿色转型，助力经济社会发展与生态环境保护双赢。低碳主题是指通过技术创新对环境可持续发展做出贡献，利用产业转型升级、产业结构调整等多种手段进行绿色低碳转型。

本基金将主要聚焦两大低碳要素“气候解决方案”和“减碳经济”以支持绿色转型。

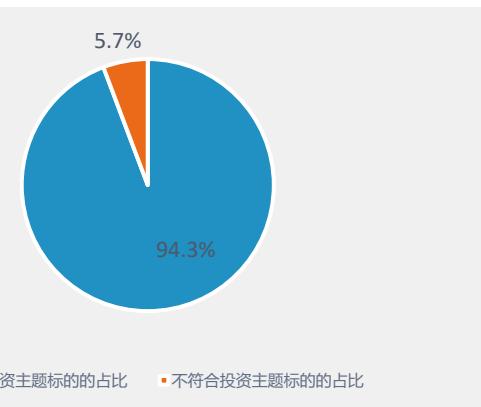
2. 投资目标和投资政策

投资范围：低碳主题股票等

投资政策：投资于本基金界定的低碳主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%。产品主题池由两部分组成。第一部分为气候解决方案，是指公司产品或服务对环境可持续性有贡献的投资标的。第二部分为减碳经济，指公司自身节能减碳表现突出、对全球升温控制贡献度高的标的。

3. 关键ESG指标

(1) 投资主题组成



说明：1.产品投资主题参考前文“投资目标和投资政策”中的定义。
2.本部分内容是对基金半年报/年报所披露股票清单对应数据的统计。
数据统计基准日：2025年06月30日。

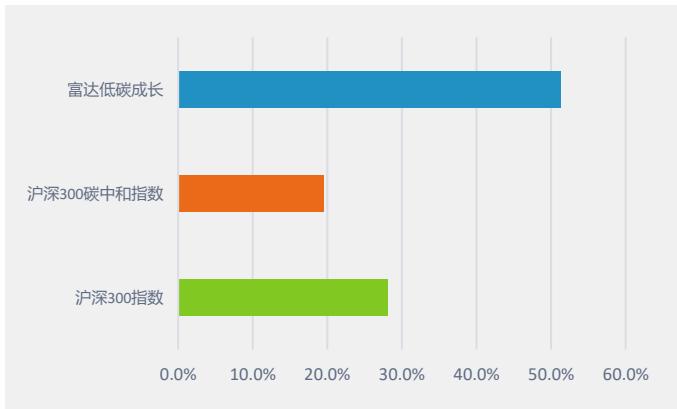
(2) 碳数据

| | 碳足迹 tCO2e | 碳强度 tCO2e /m CNY | 加权平均 碳强度 WACI |
|---------------------|--------------|------------------------|---------------------|
| 富达低碳成长 | 2,721 | 66.6 | 79.1 |
| 业绩比较基准 - 沪深300碳中和指数 | 18,681 | 317.3 | 188.2 |
| 市场宽基指数 - 沪深300指数 | 29,005 | 427.1 | 273.9 |
| 相对沪深300碳中和指数 | -85.43% | -79.00% | -57.98% |
| 相对沪深300指数 | -90.62% | -84.40% | -71.12% |

数据来源：公司层面碳数据来自 ISS，指数信息来自中证指数。本部分内容是对基金半年报/年报所披露股票清单对应数据的统计。数据统计基准日：2025年06月30日。

(3) 绿色收入情况

指基金所投资的标的或基准成分的主营收入来自于绿色收入的比例。绿色收入的定义见名词解释。



数据来源：公司层面绿色收入基于富达国际数据整合加工，指数信息来自中证指数。本部分内容是对基金半年报/年报所披露股票清单对应数据的统计。数据统计基准日：2025年06月30日。

(4) ESG评级分布

本产品不投资于富达ESG评级为E的股票，截至2025年06月30日，产品投资于富达可持续评级A-C级的股票的权重占比分别比基准权益部分成分股同评级的权重占比高1.3%，5.8%及3.2%；相对市场宽基指数沪深300成分股同评级的权重占比高1.3%，6.3%及3.5%。

富达可持续评级是富达自主研发的ESG评级体系，共分为A-E五个级别，其中A为最高评级，E为最低评级。本部分内容是对基金半年报/年报所披露股票清单对应数据的统计。数据统计基准日：2025年06月30日。指数成份来源：中证指数。

(5) 产品可持续投资实践

| ESG投资考量 | 要求 | 组合实际情况 |
|---|-----|--------|
| 产品可持续性考量 - 投资于负面剔除清单上的证券 | 0% | 0% |
| 产品主题池考量- 产品中的权益标的需要大于等于非现金基金资产的80% 来自于产品主题池 | 80% | 达标 |

本部分内容是对基金半年报/年报所披露股票清单对应数据的统计。数据统计基准日：2025年06月30日。

4. 投后管理

富达致力于与同业共同践行积极股东主义，通过与上市公司进行互动沟通及勤勉投票积极开展投后管理，主动影响实体企业绿色转型、可持续发展。

2025年上半年，富达对投资组合的进行了四次环境、社会、治理相关议题的互动沟通。其中，在2025年2月，在富达牵头下，依托中国气候联合参与平台（CCEI）平台与招商基金、鹏华基金、易方达等五家机构代表与中国石油和化学工业联合会专家共同赴企业总部开展实地调研，并与公司副总裁、董事会秘书及ESG团队就低碳转型战略展开专题研讨。该公司展现出显著的ESG管理成熟度，投资者针提出关于碳减排、披露等具体建议。

在公司与富达的共同努力下，今年年中，公司的MSCI ESG评级从B级连升两档至BBB级，万得ESG评级从A连升两档至AAA。企业ESG治理水平的提升、ESG披露报告的完善以及ESG评级的改善充分证明了富达在助力企业可持续发展中所做出的重要贡献。

资料来源：富达中国

名词解释

碳足迹

衡量基金投资所产生的温室气体排放总量的指标，为了计算基金的碳足迹，将公司的范围一和范围二碳排放量相加，并根据企业价值（包括现金 (EVIC)）和公司在投资组合中的权重进行加权。计算公式如下：

$$CO2e\text{碳足迹} = (\sum WT\text{公司}/EV\text{公司} * CO2e\text{公司})$$

WT公司= 公司在投资组合中的权重

CO2e公司=公司的年度范围一、范围二温室气体 (GHG) 排放量，以二氧化碳当量表示，单位为吨

EV公司 =企业价值，指公司在财年末普通股和优先股市值以及总债务和非控股权益账面价值之和，不扣除现金或现金等价物

碳强度

衡量投资组合每百万人民币的范围一、范围二碳排放。

加权平均碳排放强度WACI

加权平均碳排放强度提供了基金对碳密集型公司的敞口，包括范围一和范围二的碳排放，计算方法为投资组合中标的权重乘以每个持股每百万收入的二氧化碳排放当量之和。

绿色收入

绿色收入指公司产品或服务的收入来源于绿色增长、绿色转型及绿色赋能。本基金通过对公司产品或服务的收入来源进行分析，判断这些收入来源是否满足“绿色收入”要求。“绿色收入”的营业额占比超过50%的上市公司满足本基金界定的低碳成长主题。这些“绿色收入”对联合国可持续发展目标 (UN SDG) 有贡献。

富达指FIL Limited及其附属公司，富达基金指富达基金管理（中国）有限公司。

免责声明

碳数据资料来源：数据由ISS ESG提供。Institutional Shareholder Services Inc.及其联署公司 (ISS) 提供资讯的所有版权均属于ISS和/或其许可人。ISS 不提供任何类型的明示或暗示保证，以及不就ISS提供的任何数据中或与之相关的任何错误、遗漏或中断承担任何责任。该信息基于ISS提供的碳数据，截至生产日期。捕获和报告数据的日期之间可能存在时间差异。

重要信息

本资料须获富达基金书面同意方可向外发放。本资料内所载的观点，在任何情况下均不应被视为富达基金的促销或建议。富达基金对任何依赖本文而引致的损失概不负责。有意投资者应就个别投资项目的适合程度或其它因素寻求独立的意见。虽然富达基金已尽力采取措施，确保文内资料准确无误，但不拟就有关由第三方所提供的数据出现错误或遗漏承担责任。

本资料仅供数据参考用途，未经富达基金的书面同意，请勿传阅或复制本资料。本资料不应被视为邀请或推介认购富达基金任何基金或产品，或邀请或推介采用富达基金的资产管理服务。

富达 / 富达国际 / Fidelity / Fidelity International指FIL Limited及其附属公司，富达基金指富达基金管理（中国）有限公司，“富达”、“富达国际”、Fidelity、Fidelity International、Fidelity International 标志及F标志均为 FIL Limited的商标。富达只就产品及服务提供数据。富达投资指富达管理与研究公司。

投资涉及风险。本数据仅包含一般数据，并非认购基金份额的邀约，亦不应被视为建议购买或沽售任何金融工具。本数据所载数据只在数据刊发时方为准确。观点及预测或会更改而不需另作通知。本资料所载的证券(如有)仅供资料用途，在任何情况下均不应被视建议买入或卖出有关证券。

富达基金与富达国际、富达投资之间实行业务隔离制度，富达国际、富达投资并不直接参与富达基金的投资运作，富达国际、富达投资的过往投资业绩不代表富达基金的投资业绩，且不构成对富达基金管理基金业绩表现的保证。

