

# 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：南京银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 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。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                     | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                        | <b>5</b>  |
| 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.....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....        | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 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        |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                       | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 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.....             | 16        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 18        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 18        |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....        | 18        |
| 4.10 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.....      | 19        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                       | <b>19</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 19        |
| 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..... | 19        |
| 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.....      | 19        |
| <b>§ 6 审计报告</b> .....                        | <b>19</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 19        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 19        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b> .....                      | <b>21</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 21        |
| 7.2 利润表.....                                 | 23        |
| 7.3 净资产变动表.....                              | 24        |
| 7.4 报表附注.....                                | 26        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b> .....                      | <b>48</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 48        |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                  | 49        |
| 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.....     | 49        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 51        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 60        |
| 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.....    | 60        |
| 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..... | 60        |
| 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..... | 60        |
| 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.....    | 60        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                   | 60        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 60        |
| 8.12 投资组合报告附注.....                         | 61        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>                  | <b>61</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 61        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 62        |
| 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.....      | 62        |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                   | 62        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>                 | <b>63</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示.....</b>                    | <b>63</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 63        |
| 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.....      | 63        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 63        |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                        | 64        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 64        |
| 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.....         | 64        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 64        |
| 11.8 其他重大事件.....                           | 65        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>            | <b>66</b> |
| 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.....    | 66        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                   | 66        |
| <b>§ 13 备查文件目录.....</b>                    | <b>67</b> |
| 13.1 备查文件目录.....                           | 67        |
| 13.2 存放地点.....                             | 67        |
| 13.3 查阅方式.....                             | 67        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                 |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称            | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 泰信低碳经济混合发起式        |                 |
| 基金主代码           | 013469             |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                 |
| 基金合同生效日         | 2021 年 11 月 3 日    |                 |
| 基金管理人           | 泰信基金管理有限公司         |                 |
| 基金托管人           | 南京银行股份有限公司         |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 39,794,193.66 份    |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 泰信低碳经济混合发起式 A      | 泰信低碳经济混合发起式 C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 013469             | 013470          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 15,253,502.55 份    | 24,540,691.11 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要投资于低碳经济相关行业证券，在严格控制投资风险和保持基金资产良好流动性的基础上，通过积极主动的资产配置，力争实现基金资产的长期增值。 |
| 投资策略   | 本基金主要投资于低碳经济主题证券。通过对主题行业的长期跟踪和深入挖掘，获得超额收益，实现长期投资收益。                     |
| 业绩比较基准 | 中证内地低碳经济主题指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%                                       |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，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      | 泰信基金管理有限公司                      | 南京银行股份有限公司      |
| 信息披露负责人 | 姓名                              | 刘小舫             |
|         | 联系电话                            | 021-20899003    |
|         | 电子邮箱                            | xxpl@ftfund.com |
| 客户服务电话  | 400-888-5988                    | 95302           |
| 传真      | 021-20899008                    | 025-86776189    |
| 注册地址    | 中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层    | 南京市建邺区江山大街 88 号 |
| 办公地址    | 中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36-37 层 | 南京市建邺区江山大街 88 号 |
| 邮政编码    | 200120                          | 210019          |
| 法定代表人   | 李高峰                             | 谢宁              |

注：2023 年 10 月 24 日，本基金托管人南京银行股份有限公司注册地址变更为“南京市建邺区江山大街 88 号”。

## 2.4 信息披露方式

|                     |                |
|---------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》         |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ftfund.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                            |
|--------|--------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼        |
| 注册登记机构 | 泰信基金管理有限公司         | 中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 层 |

## § 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 | 2023 年        |                | 2022 年        |                | 2021 年 11 月 3 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------|---|---------------|
|               | 泰信低碳经济混合发起式 A | 泰信低碳经济混合发起式 C  | 泰信低碳经济混合发起式 A | 泰信低碳经济混合发起式 C  | 泰信低碳经济混合发起式 A                             | 泰信低碳经济混合发起式 C |
| 本期已实现收益       | -2,903,731.25 | -4,564,347.27  | -5,156,753.12 | -9,673,502.17  | -915,288.36                               | -2,169,203.90 |
| 本期利润          | -2,100,471.83 | -3,245,085.03  | -5,163,484.31 | -10,310,889.32 | -769,240.11                               | -1,831,380.82 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1205       | -0.1189        | -0.2739       | -0.3299        | -0.0423                                   | -0.0422       |
| 本期加权平均净值利润率   | -19.02%       | -18.93%        | -33.58%       | -40.48%        | -4.27%                                    | -4.26%        |
| 本期基金份额净值增长率   | -16.65%       | -17.06%        | -28.54%       | -28.90%        | -4.21%                                    | -4.29%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末       |                | 2022 年末       |                | 2021 年末                                   |               |
| 期末可供分配利润      | -7,515,947.51 | -12,231,097.03 | -5,889,899.28 | -9,467,107.03  | -915,431.21                               | -2,095,204.95 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.4927       | -0.4984        | -0.3242       | -0.3283        | -0.0503                                   | -0.0510       |

|              |              |               |               |               |               |               |
|--------------|--------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 期末基金资产净值     | 8,702,802.78 | 13,850,387.47 | 12,434,050.29 | 19,623,881.67 | 17,447,173.08 | 39,308,968.64 |
| 期末基金份额净值     | 0.5705       | 0.5644        | 0.6845        | 0.6805        | 0.9579        | 0.9571        |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2023 年末      |               | 2022 年末       |               | 2021 年末       |               |
| 基金份额累计净值增长率  | -42.95%      | -43.56%       | -31.55%       | -31.95%       | -4.21%        | -4.29%        |

注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 11 月 3 日。

2、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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

泰信低碳经济混合发起式 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 2.00%    | 1.49%       | -6.70%     | 0.94%         | 8.70%  | 0.55% |
| 过去六个月      | -15.91%  | 1.49%       | -16.91%    | 0.84%         | 1.00%  | 0.65% |
| 过去一年       | -16.65%  | 1.48%       | -21.10%    | 0.89%         | 4.45%  | 0.59% |
| 自基金合同生效起至今 | -42.95%  | 1.55%       | -37.61%    | 1.15%         | -5.34% | 0.40% |

泰信低碳经济混合发起式 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 | 1.88%    | 1.49%       | -6.70%     | 0.94%         | 8.58% | 0.55% |
| 过去六个月 | -16.10%  | 1.49%       | -16.91%    | 0.84%         | 0.81% | 0.65% |
| 过去一年  | -17.06%  | 1.48%       | -21.10%    | 0.89%         | 4.04% | 0.59% |

|                |         |       |         |       |        |       |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效<br>起至今 | -43.56% | 1.55% | -37.61% | 1.15% | -5.95% | 0.40% |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|

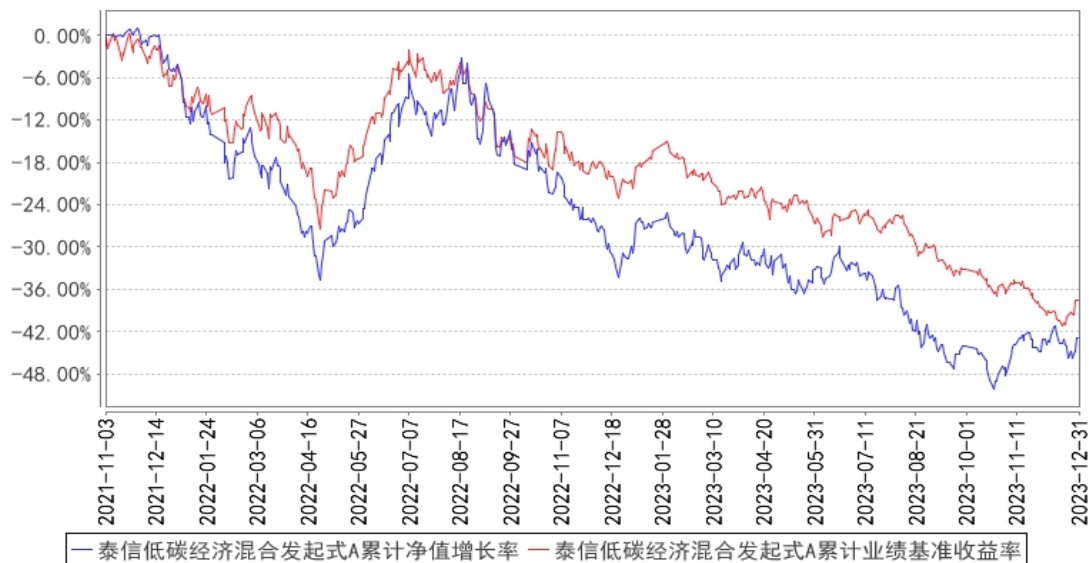
注：本基金业绩比较基准：中证内地低碳经济主题指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

1、中证内地低碳经济主题指数是为了反映在中国内地上市的低碳经济类公司股票的整体走势，从沪深 A 股中挑选日均总市值较高的 50 只低碳经济主题公司股票组成样本股，基日为 2010 年 6 月 30 日，基点为 1000 点。在编制方法上，中证内地低碳经济主题指数采用了主流的市值加权方法，具有较好的市场代表性。

2、中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，指数样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成。该指数涵盖了银行间和交易所债券市场，具有广泛的市场代表性，适合作为本基金的业绩比较基准。

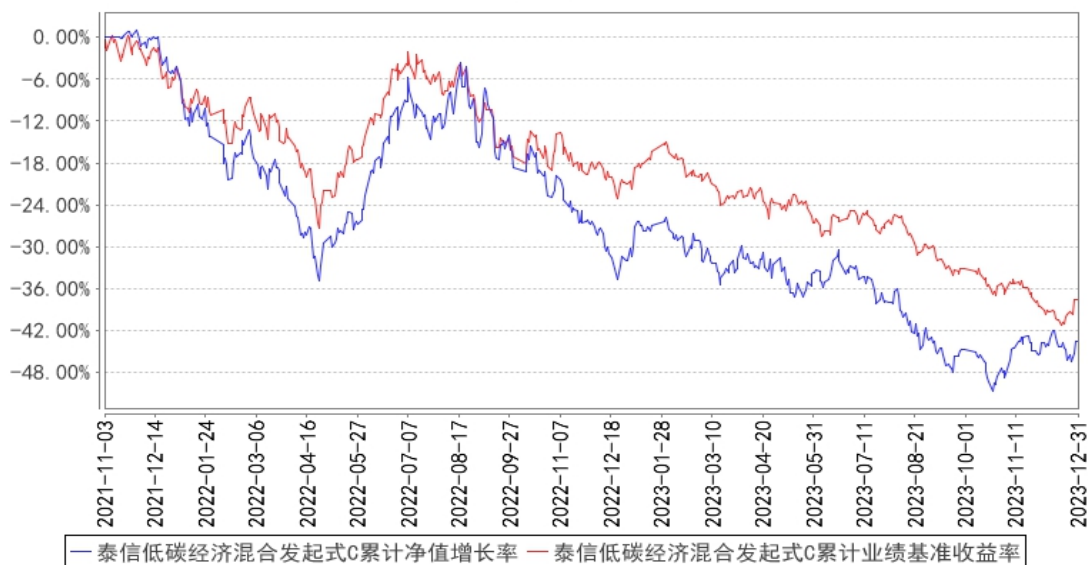
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰信低碳经济混合发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





泰信低碳经济混合发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图

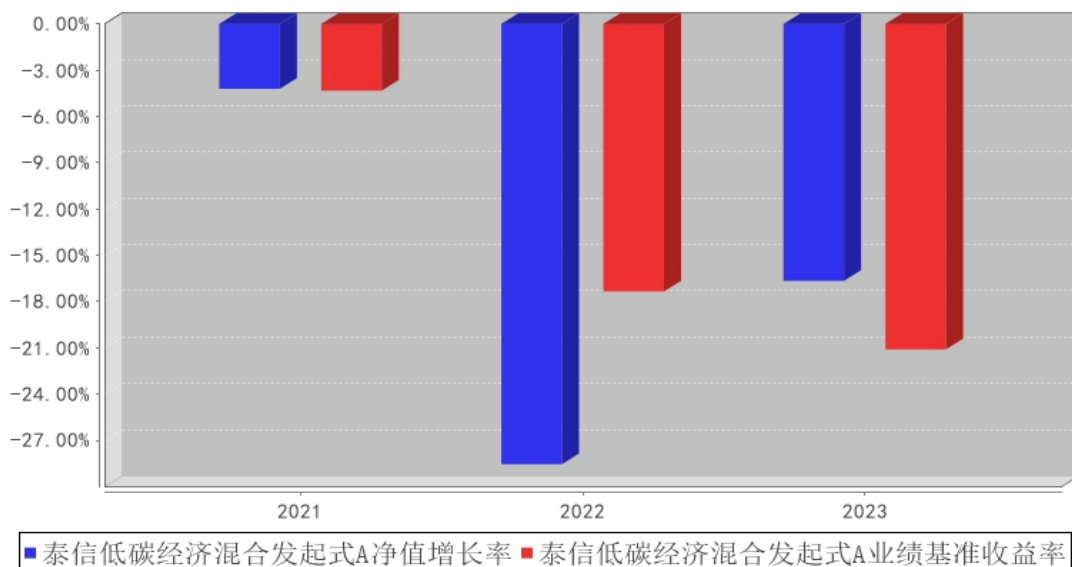


注：1、本基金基金合同于 2021 年 11 月 3 日生效。

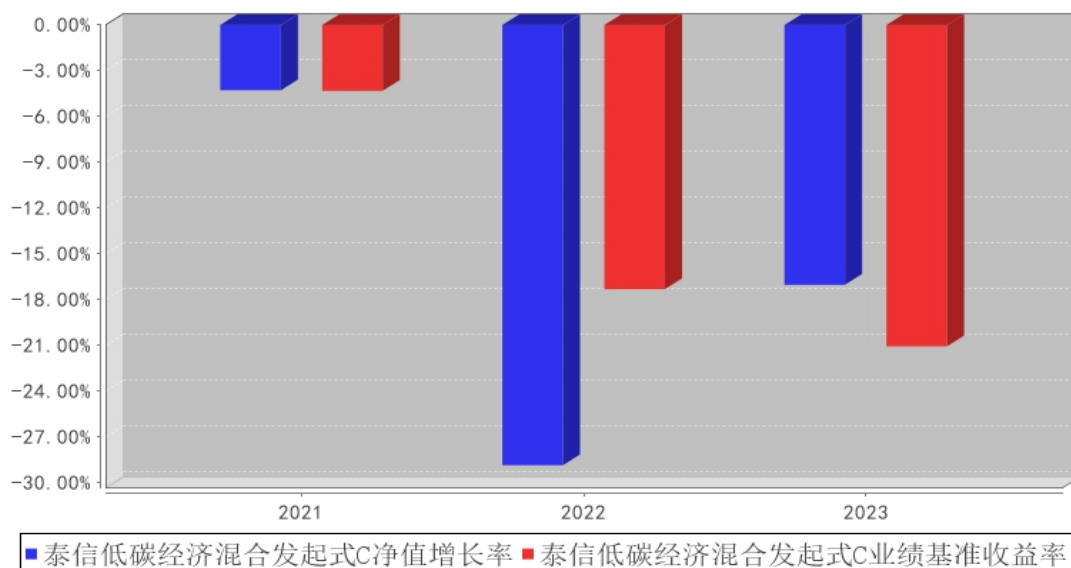
2、基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的 60-95%。投资于低碳经济相关行业证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

### 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

泰信低碳经济混合发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



泰信低碳经济混合发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2021 年 11 月 3 日正式生效，2021 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2021年11月3日正式生效，过去三年未进行利润分配。

## § 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

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：李高峰

总经理：李高峰代任

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：徐磊

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛

国信实业有限公司共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是“好人举手”制度下，获准筹建的第一家以信托公司为主发起人的基金管理公司。

公司目前下设上海锐懿资产管理有限公司、营销支持中心、产品研发部、渠道服务部、战略客户部、机构业务部、深圳分公司、北京分公司、金融科技部、权益投资部、固收投资部、研究部、专户投资部、清算会计部、集中交易部、计划财务部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部、董监事工作部（党群工作部）、综合管理部。截至 2023 年 12 月末，公司有正式员工 118 人，多数具有硕士以上学历。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

截至 2023 年 12 月末，泰信基金管理有限公司旗下共有泰信天天收益货币、泰信先行策略混合、泰信双息双利债券、泰信优质生活混合、泰信优势增长混合、泰信蓝筹精选混合、泰信债券增强收益、泰信发展主题混合、泰信债券周期回报、泰信中证 200 指数、泰信中小盘精选混合、泰信行业精选混合、泰信现代服务业混合、泰信鑫益定期开放债券、泰信国策驱动混合、泰信鑫选混合、泰信互联网+混合、泰信智选成长、泰信鑫利混合、泰信竞争优选混合、泰信景气驱动 12 个月持有期混合、泰信低碳经济混合发起式、泰信均衡价值混合、泰信汇利三个月定开债券、泰信医疗服务混合发起式、泰信添利 30 天持有期债券发起式、泰信鑫瑞债券发起式、泰信汇盈债券、泰信优势领航混合、泰信汇鑫三个月定开债券、泰信添鑫中短债债券、泰信添益 90 天持有期债券共 32 只开放式基金及 55 个资产管理计划。

#### 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 |        |   |
| 吴秉韬 | 研究部总监、泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信优质生活混合型证券投资基金基金经理、泰信低碳经济混合发 | 2021 年 11 月 3 日 | -    | 12 年   | 吴秉韬先生，上海交通大学环境工程专业硕士。2011 年 4 月加入泰信基金管理有限公司，历任助理研究员、研究员、研究员兼基金经理助理、基金经理兼研究员，现任研究部总监兼基金经理。2019 年 7 月至今任泰信国策驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月至今任泰信优质生活混合型证券投资基金基金经理，2021 年 11 月至今任泰信低碳经济混合发起式证券投资基金基金经理，2022 年 9 月至今任泰信优势领航混合型证券投资基金基金经理。 |

|                                  |  |  |  |  |
|----------------------------------|--|--|--|--|
| 起式证券投资基金基金经理、泰信优势领航混合型证券投资基金基金经理 |  |  |  |  |
|----------------------------------|--|--|--|--|

注：1、以上日期均是指公司公告的日期。

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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，本基金管理人严格遵循《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信低碳经济混合发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产。本基金管理人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，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

#### 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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《泰信基金管理有限公司公平交易管理办法》以及《泰信基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，主要控制方法如下：

- 1、建立统一的研究平台，所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放。
- 2、建立全公司投资对象备选库和各投资组合的投资对象备选库。
- 3、投委会作为公司受托资产投资的最高决策机构，主要负责对公司所管理的受托资产进行投资决策。投资总监在其权限范围内审批超出投资组合经理权限的投资计划。投资组合经理在其权限范围内进行投资决策。
- 4、投资组合经理同时管理多个投资组合时，必须公平公正的对待管理的所有投资组合，除申购赎回、个股投资比例超标等客观因素之外，同一交易日投资同一交易品种时，应尽可能使他们获得相同或相近的交易价格。

严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

5、集中交易部负责所有投资指令的执行，必须确保所有同向指令的公平公正，平等对待所有投资组合。发现异常指令或者涉嫌利益输送的指令，集中交易部应立即停止执行指令，并向投资总监和风险管理部报告。对非竞争竞价指令，不同投资组合也必须公平对待，主要采取成交结果按比例分配和轮候方式处理。

6、风险管理部通过交易系统监控指标设置，实时监控交易指令，禁止同一投资组合内部的同时反向交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

7、公司在交易系统中设置强制公平委托参数，强制交易系统对符合要求的同一交易品种的同向指令执行公平委托。

8、风险管理部定期与不定期对交易指令的公平性和交易委托的公平性进行分析，对强制公平委托的执行过程与结果进行检查；对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，并完成定期分析报告。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易部集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，根据投资交易监控与价差分析情况，未发现基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 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

2023 年一季度，3 月官方制造业 PMI 录得 51.9%，较上月回落 0.7 个百分点，整体仍处景气

区间，但较 2 月有所回调，有相当原因在于春节错位影响。需求端方面，3 月新订单指数为 53.6%，相较上月下降 0.5 个百分点；生产指数为 54.6%，相较上月下降 2.1 个百分点，生产景气度仍要略高于需求景气度，两者均位于荣枯线之上。价格方面，3 月主要原材料购进价格指数为 50.9%，较前值 54.4% 下降 3.5 个百分点。出厂价格指数为 48.6%，较前值 51.2% 下降 2.6 个百分点，出厂价格指数重回收缩区间。3 月建筑业与服务业商务活动指数双双续升至 65.6%、56.9%，景气扩张的持续性的确好于制造业。总体来看，3 月官方 PMI 数据反映出我国经济基本面持续修复的趋势仍在持续，后续经济进一步的复苏情况取决于外需走弱、内需修复以及行业层面房地产行业修复进程的综合影响，仍有待进一步验证。流动性方面，3 月央行公开市场逆回购大幅净回笼，MLF 超额续作净投放，同时超预期降准投放中长期流动性，由此来看，央行操作延续缩短放长的思路。尽管央行投放中长期流动性，但资金面整体明显收敛，且上行幅度超季节性，尤其 R007 和 DR007 显示流动性分层加剧，这或显示融资需求延续强势，银行在季末信贷投放增加。我们认为在经济恢复尚处于脆弱的阶段，货币政策宽松的逻辑并未发生显著变化。本基金一季度主要以电力设备新能源行业为主的低碳板块配置。

2023 年二季度，6 月官方制造业 PMI 录得 49%，较上月回升 0.2 个百分点，6 月 PMI 延续 4，5 月继续低迷，仍处于收缩区间，需求不足可能是制约当前制造业生产回暖的重要因素。需求端方面，6 月生产指数回升 0.7 个百分点至 50.3%，重回扩张区间，但仍为近 5 年最低水平。生产小幅扩张暂未带动企业采购增加，反映企业生产经营预期仍相对谨慎。新订单指数回升 0.3 个百分点至 48.6%，为近 5 年的最低水平，制造业需求仍偏弱。价格方面，6 月购进价格与出厂价格指数分别回升 4.2、2.3 个百分点至 45.0%、43.9%，仍显著低于 50% 的临界水平。6 月非制造业商务活动指数回落 1.3 个百分点至 53.2%，为近 10 年 6 月份最低水平，非制造业扩张速度有所放缓。总体来看，制造业景气度基本持平，小幅改善且持续性不强，需求仍然偏弱，企业仍在加速去库存；出口动能继续回落；保就业压力在增加，当前经济仍在承压，政策发力的必要性增强。展望后续，经济环比动能或将进入震荡筑底时期。流动性方面，二季度货币政策例会在“精准有力实施稳健的货币政策，搞好跨周期调节”的同时，明确要“加大宏观政策调控力度”“切实支持扩大内需，改善消费环境，促进经济良性循环”、“加大逆周期调节力度，综合运用政策工具，切实服务实体经济”。我们认为在稳健的大基调下，央行将发挥结构性货币政策工具的作用。本基金二季度主要以电力设备新能源行业为主的低碳板块配置。

2023 年三季度，9 月官方制造业 PMI 录得 50.2%，较上月回升 0.5 个百分点，环比连续 4 个月回升，景气值自今年 3 月以来重回扩张区间，供需两端进一步改善。供需方面，9 月 PMI 生产指数 52.7%，较上个月回升 0.8 个百分点，显示制造业生产节奏进一步加快；9 月新订单指数回

升 0.3 个百分点至 50.5%。进出口方面，新出口订单指数回升 1.1 个百分点至 47.8%。价格方面，在 9 月南华工业品继续反弹，原材料购进价格指数维持扩张态势，回升 2.9 个百分点至 59.4%，同时，出厂价格指数也回升 1.5 个百分点至 53.5%，其中，原材料购进价格继续扩张显示制造业企业成本端压力尚在增加。9 月非制造业商务活动回升 0.7 个百分点至 51.7%，非制造业扩张力度有所增强。服务业方面，9 月服务业商务活动回升 0.4 个百分点至 50.9%，结束连续 5 个月的下跌趋势。总体来看，9 月官方 PMI 数据反映制造业与非制造业企业景气均现改善，生产扩张进一步加快，但需求修复有所分化、服务业扩张动能仍不强。往后看，经济有望筑底企稳，回升的力度有待进一步观察。流动性方面，央行货币政策委员会三季度例会表述“搞好逆周期和跨周期调节”，一方面反映的是四季度可能迎来国内经济周期的拐点，多项经济指标预计继续好转；另一方面也意味着央行研判经济形势好转的同时不会回撤政策力度。我们认为在经济恢复尚处于脆弱的阶段，货币政策宽松的逻辑并未发生显著变化。本基金三季度仍保持新能源，以及智能汽车等低碳板块为主要配置。

2023 年四季度，12 月官方制造业 PMI 录得 49%，较上月回落 0.4 个百分点，继续环比回落，仍处荣枯线以下，需求收缩问题进一步突出。制造业 PMI 低于过去 5 年历史均值（剔除 2020 年）约 0.7 个百分点。四季度为出口淡季，海外订单减少，叠加国内有效需求不足，是我国制造业企业当前面临的首要困难。需求端看，12 月新订单指数环比回落 0.7 个百分点至 45.8%，连续 3 个月在收缩区间回落。外需指标持续回落，出口压力仍然较大；而内需略有上升，但回升速度放缓，拉动新订单指数边际回升。生产端看，12 月 PMI 生产指数环比下降 0.5 个百分点至 50.2%，已连续 7 个月处于扩张区间，但低于历史同期均值，扩张速度有所减缓。价格端看，原材料与出厂价格指数分居扩张区间和收缩区间，12 月原材料购进价格指数环比上升 0.8 个百分点至 51.5%，而出厂价格指数环比回落 0.5 个百分点至 47.7%。原材料价格上升、出厂价格下降，企业盈利水平可能也受到挤压。12 月份，非制造业 PMI 50.4%，比上月回升 0.2 个百分点，继续保持在扩张区间。总体来看，12 月制造业 PMI 继续收缩，已连续三个月处于临界点以下；产需继续分化，但都低于季节性水平，反映出四季度以来经济复苏动能转弱，制造业整体供过于求的现实。流动性方面，四季度货币委员会例会谈及国内经济，重点提到“有效需求不足，社会预期偏弱”。与三季度仅强调了“有效需求不足”，四季度货币政策例会似乎对经济挑战强调更多。货币政策方面，新增表述“保持社会融资规模、货币供应量同经济增长和价格水平预期目标相匹配。”相比三季度“搞好逆周期和跨周期调节”，本次会议强调“更加注重做好逆周期和跨周期调节”，更加注重的表述结合 2024 年预计 5% 的增长目标似乎预示央行政策力度可能加大，后续需持续跟踪。本基金四季度适度增加消费电子，人工智能等低碳板块的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信低碳经济混合发起式 A 基金份额净值为 0.5705 元,本报告期基金份额净值增长率为-16.65%;截止本报告期末泰信低碳经济混合发起式 C 基金份额净值为 0.5644 元,本报告期基金份额净值增长率为-17.06%;同期业绩比较基准收益率为-21.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对当前宏观环境的判断:2024 年 1 月制造业 PMI 为 49.2%,比上月上升 0.2 个百分点,制造业景气水平略有回升,但仍位于收缩区间,经济修复基础仍需巩固。需求端,新订单指数环比上升 0.3 个百分点至 49.0%。新出口订单指数较上月上升 1.4 个百分点至 47.2%,外需回升,经济运行动力有所增强。生产指数较上月上升 1.1 个百分点至 51.3%,连续 8 个月维持在扩张区间,并达到近 4 个月以来最高水平。价格方面,1 月出厂价格回落 0.7 个百分点至 47.0%,仍位于临界点以下,主要原材料购进价格指数回落 1.1 个百分点至 50.4%,仍位于临界点之上。PMI 出厂价格与原材料差值由-3.8%收缩为-3.4%,企业面临的成本压力有所缓和。库存方面,1 月份产成品库存指数为 49.4%,较上月提升 1.6 个百分点;原材料库存指数回落 0.1 个百分点至 47.6%,生产经营活动预期下降 1.9 个百分点至 54%,稳定位于扩张区间。非制造业 PMI 商务活动指数为 50.7%,比上月上升 0.3 个百分点。分行业看,建筑业商务活动指数为 53.9%,比上月下降 3.0 个百分点;服务业商务活动指数为 50.1%,比上月上升 0.8 个百分点。总结来看,需求修复弱于生产,我们认为,政策仍需积极发力提振总需求,才能保障经济景气持续改善。

流动性方面,四季度货币委员会例会谈及国内经济,重点提到“有效需求不足,社会预期偏弱”。货币政策方面,新增表述“保持社会融资规模、货币供应量同经济增长和价格水平预期目标相匹配。”相比三季度,本次会议强调“更加注重做好逆周期和跨周期调节”,更加注重的表述结合 2024 年预计 5%的增长目标似乎预示央行政策力度可能加大,后续需持续跟踪。

我们对当前市场的判断:四季度以来的经济数据,反映出制造业大体上仍然呈现收缩态势,产需继续分化,且低于季节性水平,经济修复有所反复,有效需求不足,社会预期偏弱增长动能不足。流动性方面,四季度货币委员会例会对经济挑战强调更多,货币政策方面,新增表述“保持社会融资规模、货币供应量同经济增长和价格水平预期目标相匹配。”相比三季度“搞好逆周期和跨周期调节”,本次会议强调“更加注重做好逆周期和跨周期调节”,更加注重的表述结合 2024 年预计 5%的增长目标似乎预示央行政策力度可能加大,后续需持续跟踪。海外方面,美联储 1 月议息会议决议,维持当前利率不变,本次会议正式确认了美联储决策重心由加息范式向降息范式转变。我们认为美国经济软着陆依旧是美联储设想的基准情形。美国通胀方面,声明中表示“实现就业和通胀目标的风险正在走向更好的平衡”,暗示本轮加息历程已到达尾声。我们认为 2024



年美联储仍着力平衡经济增长和通胀回落。美联储的降息的开启，这对全球的风险资产都将是正面的促进。总体上，经济基本面方面，有效需求不足，价格收缩，社会预期偏弱，增长动能不足。流动方面，国内和海外的流动性相对宽松。市场的资金方面，目前持续的亏钱效应，造成市场资金面的供需不匹配，我们认为在市场在解决完资金面的问题后，市场经过长时间的回调，价值逐步突显。我们认为低碳板块经过 2 年的回调，行业基本面出清在即，很多细分的子行业经过大幅下跌，价值凸显，本基金仍将重点关注以新能源，人工智能等低碳板块的投资机会。

#### 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，本基金管理人合规管理及内部控制工作本着对基金份额持有人利益高度负责的精神，以独立于各业务部门的风险管理部、监察稽核部为主体，对基金销售、投资运作、后台保障等主要业务活动进行监督与控制，较好地保证了基金运作的合规性。

##### 1、进一步完善制度建设，构建全面有效的内部控制体系

本基金管理人根据最新出台的相关法律法规，及时补充及完善了内部管理制度，同时对业务流程进一步梳理，严格按照监管要求进行风险控制评估及合规管理有效性评估，确保风险控制及合规管理的有效性，不断提升内部控制水平。

##### 2、进一步规范基金投资管理 workflow，加强基金投资风险控制

(1) 加强基金的日常投资交易进行监控，及时提示相关风险。公司风险管理部负责基金日常投资行为的监控，并与相关基金经理沟通，提示相关风险。同时根据投委会的投资决议、政策法规规定对风险指标设置进行调整，不定期检查风险监控指标设置，并根据新的需求对风险监控指标进行测试和更新。

(2) 规范投资交易行为，防范交易环节的操作风险。公司禁止基金内的同日反向交易，严格控制旗下管理投资组合间的同日反向交易，对基金间同日同向交易、所有投资组合对单只股票成交量占其市场总成交异常等指标进行预警监控。对于日常的投资监控，公司实行的是事前控制、事中监督、事后检查的方法，在公平交易的各环节建立了责任追究制，实行各部门责任人、分管领导责任人负责制，以最大限度地监控并处置可能造成不公平交易或利益输送的行为。

##### 3、加强内部的监察稽核

针对基金投资运作通过日常监察与专项稽核相结合，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，通过查漏补缺、及时整改强化了风险控制流程，提高了投资管理及运营相关人员的风险意识水平，从而较好地预防风险，维护基金持有人利益。

##### 4、做好投研交易等人员的合规培训，提高合规意识

公司组织投研人员开展内幕交易案例合规培训，就近年来发生的典型内幕交易案例作了分类

汇报，并对目前市场上的疑似内幕交易、有争议的内幕交易案例进行了说明，要求投研人员遵守投资纪律，规范决策流程，从源头避免内幕交易事件的发生，加强了投研人员的合规意识。

在本报告期内，本基金的投资运作各环节基本符合规定的要求，未出现异常交易、操纵市场、内幕交易等违法违规现象。今后公司将继续夯实内部控制和风险管理工 作，保证基金运作的合规性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，保证基金估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本公司建立估值委员会，负责本公司基金估值业务的决策和评价、与基金估值业务相关的信息披露规定等工作。

本公司管理的基金日常估值由公司清算会计部负责。清算会计部完成估值后，将估值结果以合同约定的形式发送基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，由管理人按约定对外公布；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本公司在采用估值政策和程序时，应当充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过建立估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

##### 一、基金收益分配原则

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

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、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每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，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；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

本报告期内无需要说明的相关情形。

### § 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，南京银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、利润分配以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由泰信基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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     | 德师报(审)字(24)第 P00029 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 | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金全体持有人：  |
| 审计意见    | 我们审计了泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。 |

|                 |  |
|-----------------|--|
| 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，我们独立于泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金，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>   |
| 其他信息            | <p>泰信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金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。</p> <p>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。</p> <p>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，我们无任何事项需要报告。</p>      |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰信低碳经济混合型发起式证券投资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，除非基金管理人管理层计划清算泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰信低碳经济混合型发起式证券投资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。</p> <p>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：</p> <p>(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</p>  |

|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 评价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合理性。</p> <p>(4) 对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，就可能对泰信低碳经济混合发起式证券投资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泰信低碳经济混合发起式证券投资基金不能持续经营。</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。</p> <p>我们与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 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)   |
| 注册会计师的姓名  | 胡小骏 谭麟林  |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼   |
| 审计报告日期    | 2024 年 3 月 26 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：泰信低碳经济混合发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 货币资金       | 7.4.7.1 | 2,698,461.32            | 3,265,992.98             |
| 结算备付金      |         | 307,899.96              | 523,802.80               |
| 存出保证金      |         | 93,817.07               | 107,003.98               |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 20,428,701.29           | 28,535,231.24            |
| 其中：股票投资    |         | 20,428,701.29           | 28,535,231.24            |
| 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        | 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         |            | 153,866.19                 | 16,777.49                   |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 619.67                     | 3,537.99                    |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 23,683,365.50              | 32,452,346.48               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>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        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | 854,061.74                 | -                           |
| 应付赎回款         |            | 21,217.45                  | 3,761.34                    |
| 应付管理人报酬       |            | 22,883.42                  | 41,804.89                   |
| 应付托管费         |            | 3,813.90                   | 6,967.47                    |
| 应付销售服务费       |            | 5,856.09                   | 8,499.59                    |
| 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    | 222,342.65                 | 333,381.23                  |
| 负债合计          |            | 1,130,175.25               | 394,414.52                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.7    | 39,794,193.66              | 47,003,395.63               |
| 其他综合收益        |            | -                          | -                           |
| 未分配利润         | 7.4.7.8    | -17,241,003.41             | -14,945,463.67              |
| 净资产合计         |            | 22,553,190.25              | 32,057,931.96               |
| 负债和净资产总计      |            | 23,683,365.50              | 32,452,346.48               |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 39,794,193.66 份。其中：泰信低碳经济混

合发起式 A 份额净值人民币 0.5705 元，基金份额总额 15,253,502.55 份；泰信低碳经济混合发起式 C 份额净值人民币 0.5644 元，基金份额总额 24,540,691.11 份。

## 7.2 利润表

会计主体：泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | -4,697,515.78                             | -14,518,999.65                                 |
| 1. 利息收入                |            | 19,006.82                                 | 39,907.71                                      |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.9    | 18,808.33                                 | 37,323.06                                      |
| 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             |            | 198.49                                    | 2,584.65                                       |
| 其他利息收入                 |            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -6,864,907.03                             | -13,933,193.91                                 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.10   | -7,015,257.68                             | -14,167,091.71                                 |
| 基金投资收益                 |            | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.11   | -   | -  |
| 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   | 150,350.65                                | 233,897.80                                     |
| 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   | 2,122,521.66                              | -644,118.34                                    |
| 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   | 25,862.77                                 | 18,404.89                                      |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 648,041.08                                | 955,373.98                                     |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 397,659.22                                | 615,279.67                                     |
| 其中：暂估管理人报酬             |            | -   | -  |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 66,276.54                                 | 102,546.60                                     |

|                            |            |               |                |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 86,105.32     | 128,107.54     |
| 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   | 98,000.00     | 109,440.17     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -5,345,556.86 | -15,474,373.63 |
| 减: 所得税费用                   |            | -             | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -5,345,556.86 | -15,474,373.63 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -5,345,556.86 | -15,474,373.63 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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                           | 47,003,395.63                          | -      | -14,945,463.67 | 32,057,931.96 |
| 加：会计政策变更                            | -                                      | -      | -              | -             |
| 前期差错更正                              | -                                      | -      | -              | -             |
| 其他                                  | -                                      | -      | -              | -             |
| 二、本期期初净资产                           | 47,003,395.63                          | -      | -14,945,463.67 | 32,057,931.96 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -7,209,201.97                          | -      | -2,295,539.74  | -9,504,741.71 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                      | -      | -5,345,556.86  | -5,345,556.86 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -7,209,201.97                          | -      | 3,050,017.12   | -4,159,184.85 |



|  |                       |        |                |                |
|--|-----------------------|--------|----------------|----------------|
| 其中：1. 基金申购款                              | 9,370,541.51          | -      | -3,201,281.05  | 6,169,260.46   |
| 2. 基金赎回款                                 | -16,579,743.48        | -      | 6,251,298.17   | -10,328,445.31 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                     | -      | -              | -              |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                     | -      | -              | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 39,794,193.66         | -      | -17,241,003.41 | 22,553,190.25  |
| 项目                                       | 上年度可比期间               |        |                |                |
|  | 2022年1月1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                                | 59,285,472.76         | -      | -2,529,331.04  | 56,756,141.72  |
| 加：会计政策变更                                 | -                     | -      | -              | -              |
| 前期差错更正                                   | -                     | -      | -              | -              |
| 其他                                       | -                     | -      | -              | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 59,285,472.76         | -      | -2,529,331.04  | 56,756,141.72  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -12,282,077.13        | -      | -12,416,132.63 | -24,698,209.76 |
| (一)、综合收益总额                               | -                     | -      | -15,474,373.63 | -15,474,373.63 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | -12,282,077.13        | -      | 3,058,241.00   | -9,223,836.13  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 17,016,520.85         | -      | -2,674,056.45  | 14,342,464.40  |
| 2. 基金赎回款                                 | -29,298,597.98        | -      | 5,732,297.45   | -23,566,300.53 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净                   | -                     | -      | -              | -              |

|                    |               |   |                |               |
|--------------------|---------------|---|----------------|---------------|
| 资产变动（净资产减少以“-”号填列） |               |   |                |               |
| （四）、其他综合收益结转留存收益   | -             | - | -              | -             |
| 四、本期期末净资产          | 47,003,395.63 | - | -14,945,463.67 | 32,057,931.96 |

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：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>李高峰</u> | <u>叶振宇</u> | <u>顾颖</u> |
| 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

泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金(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”)证监许可[2021]第 2649 号《关于准予泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由泰信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 62,111,876.04 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第 00573 号验资报告。

《泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2021 年 11 月 3 日正式生效。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金基金合同》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,包括国内依法发行或上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、股指期货、货币市场工具、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但

须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票投资占基金资产的 60-95%。投资于低碳经济相关行业证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准为中证内地低碳经济主题指数收益率 $\times$ 70%+中证全债指数收益率 $\times$ 30%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1) 金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分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。

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,且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,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金

融资产条件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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

## 2) 金融负债的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违

约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估

值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支

持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

### 3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

### 4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

## 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

## 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，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；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 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《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》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 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，根据《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》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566号）所规定的固定收益品种，本基金根据该标准的相关规定进行估值、减值计量。

### 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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。



#### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、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[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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《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]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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018年1月1日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金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。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不计缴企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对于基金从事A股买卖, 出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税; 自2023年8月28日起, 出让方减按0.05%的税率缴纳证券(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 活期存款  | 2,698,461.32       | 3,265,992.98        |
| 等于：本金 | 2,698,181.82       | 3,265,454.35        |

|                |              |              |
|----------------|--------------|--------------|
| 加：应计利息         | 279.50       | 538.63       |
| 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             | 2,698,461.32 | 3,265,992.98 |

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日  |      |               |              |
|---------------|--------------------------|------|---------------|--------------|
|               | 成本                       | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | 18,466,426.64            | -    | 20,428,701.29 | 1,962,274.65 |
| 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            | 18,466,426.64            | -    | 20,428,701.29 | 1,962,274.65 |
| 项目            | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |      |               |              |
|               | 成本                       | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | 28,695,478.25            | -    | 28,535,231.24 | -160,247.01  |
| 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 | 28,695,478.25 | - | 28,535,231.24 | -160,247.01 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | 0.92                |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 142,342.65         | 223,380.31          |
| 其中：交易所市场    | 142,342.65         | 223,380.31          |
| 银行间市场       | -                  | -                   |
| 应付利息        | -                  | -                   |
| 预提费用        | 80,000.00          | 110,000.00          |
| 合计          | 222,342.65         | 333,381.23          |

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 泰信低碳经济混合发起式 A

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |               |
|---------------|-----------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额          |
| 上年度末          | 18,165,757.45               | 18,165,757.45 |
| 本期申购          | 1,322,744.65                | 1,322,744.65  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,234,999.55               | -4,234,999.55 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                           | -             |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                           | -             |
| 本期申购          | -                           | -             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                           | -             |
| 本期末           | 15,253,502.55               | 15,253,502.55 |

##### 泰信低碳经济混合发起式 C

| 项目   | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |               |
|------|-----------------------------|---------------|
|      | 基金份额（份）                     | 账面金额          |
| 上年度末 | 28,837,638.18               | 28,837,638.18 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期申购          | 8,047,796.86   | 8,047,796.86   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,344,743.93 | -12,344,743.93 |
| 基金拆分/份额折算前    | -              | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -              | -              |
| 本期申购          | -              | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -              | -              |
| 本期末           | 24,540,691.11  | 24,540,691.11  |

注：申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 泰信低碳经济混合发起式 A

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分      | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|------------|---------------|
| 上年度末           | -5,889,899.28 | 158,192.12 | -5,731,707.16 |
| 加：会计政策变更       | -             | -          | -             |
| 前期差错更正         | -             | -          | -             |
| 其他             | -             | -          | -             |
| 本期期初           | -5,889,899.28 | 158,192.12 | -5,731,707.16 |
| 本期利润           | -2,903,731.25 | 803,259.42 | -2,100,471.83 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,277,683.02  | 3,796.20   | 1,281,479.22  |
| 其中：基金申购款       | -468,631.21   | 12,260.76  | -456,370.45   |
| 基金赎回款          | 1,746,314.23  | -8,464.56  | 1,737,849.67  |
| 本期已分配利润        | -             | -          | -             |
| 本期末            | -7,515,947.51 | 965,247.74 | -6,550,699.77 |

##### 泰信低碳经济混合发起式 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分        | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|--------------|----------------|
| 上年度末           | -9,467,107.03  | 253,350.52   | -9,213,756.51  |
| 加：会计政策变更       | -              | -            | -              |
| 前期差错更正         | -              | -            | -              |
| 其他             | -              | -            | -              |
| 本期期初           | -9,467,107.03  | 253,350.52   | -9,213,756.51  |
| 本期利润           | -4,564,347.27  | 1,319,262.24 | -3,245,085.03  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,800,357.27   | -31,819.37   | 1,768,537.90   |
| 其中：基金申购款       | -2,836,411.89  | 91,501.29    | -2,744,910.60  |
| 基金赎回款          | 4,636,769.16   | -123,320.66  | 4,513,448.50   |
| 本期已分配利润        | -              | -            | -              |
| 本期末            | -12,231,097.03 | 1,540,793.39 | -10,690,303.64 |

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 |
|----|--------------------------------------|-----------------------------------|
|----|--------------------------------------|-----------------------------------|

|           | 日         | 12月31日    |
|-----------|-----------|-----------|
| 活期存款利息收入  | 13,215.24 | 29,098.33 |
| 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 | 4,048.48  | 6,372.60  |
| 其他        | 1,544.61  | 1,852.13  |
| 合计        | 18,808.33 | 37,323.06 |

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -7,015,257.68               | -14,167,091.71                   |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                           | -                                |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                           | -                                |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                           | -                                |
| 合计               | -7,015,257.68               | -14,167,091.71                   |

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 350,805,156.73              | 512,870,684.94                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 356,964,026.43              | 525,685,360.97                   |
| 减：交易费用     | 856,387.98                  | 1,352,415.68                     |
| 买卖股票差价收入   | -7,015,257.68               | -14,167,091.71                   |

#### 7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 |
|---------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 150,350.65                      | 233,897.80                           |
| 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            | 150,350.65                      | 233,897.80                           |

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2023年1月1日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 2,122,521.66                    | -644,118.34                          |
| 股票投资                   | 2,122,521.66                    | -644,118.34                          |
| 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                     | 2,122,521.66                    | -644,118.34                          |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022<br>年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 25,040.84                       | 17,871.61                            |
| 基金转换费收入 | 821.93                          | 533.28                               |

|    |           |           |
|----|-----------|-----------|
| 合计 | 25,862.77 | 18,404.89 |
|----|-----------|-----------|

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|---------|----------------------------------|----------------------------------|
|         | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
| 审计费用    | 30,000.00                        | 14,440.17                        |
| 信息披露费   | 50,000.00                        | 80,000.00                        |
| 证券出借违约金 | -                                | -                                |
| 账户维护费   | 18,000.00                        | 15,000.00                        |
| 合计      | 98,000.00                        | 109,440.17                       |

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                   | 与本基金的关系   |
|-------------------------|-----------|
| 泰信基金管理有限公司              | 基金管理人     |
| 南京银行股份有限公司（“南京银行”）      | 基金托管人     |
| 山东省鲁信投资控股集团有限公司（“鲁信集团”） | 基金管理人的股东  |
| 江苏省投资管理有限责任公司           | 基金管理人的股东  |
| 青岛国信实业有限公司              | 基金管理人的股东  |
| 上海锐懿资产管理有限公司            | 基金管理人的子公司 |

注：下述关联方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

##### 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。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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。

#### 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<br>2023年1月1日至2023年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年<br>12月31日 |
|------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 397,659.22                      | 615,279.67                           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 149,247.94                      | 228,949.87                           |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 248,411.28                      | 386,329.80                           |

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

2、根据《泰信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同等事项的公告》，自2023年8月14日起，本基金管理费由1.50%变更为1.20%。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年1月1日至2023年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年<br>12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 66,276.54                       | 102,546.60                           |

注：1、支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

2、根据《泰信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同等事项的公告》，自2023年8月14日起，本基金托管费率由0.25%变更为0.20%。



## 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<br>2023年1月1日至2023年12月31日      |               |           |
|----------------|----------------------------------|---------------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |               |           |
|                | 泰信低碳经济混合发起式 A                    | 泰信低碳经济混合发起式 C | 合计        |
| 泰信基金管理有限公司     | -                                | 31,365.97     | 31,365.97 |
| 合计             | -                                | 31,365.97     | 31,365.97 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |               |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |               |           |
|                | 泰信低碳经济混合发起式 A                    | 泰信低碳经济混合发起式 C | 合计        |
| 泰信基金管理有限公司     | -                                | 40,647.25     | 40,647.25 |
| 合计             | -                                | 40,647.25     | 40,647.25 |

注：支付给销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。C 级份额：支付的销售服务费按前一日 C 级基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$C \text{ 级日基金销售服务费} = \text{前一日 C 级基金资产净值} \times 0.50\% \div \text{当年天数}。$$

## 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

## 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

份额单位：份

| 项目          | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|-----------------------------|
|             |                             | 泰信低碳经济混合发起式 A               |
| 报告期初持有的基金份额 | -                           | 10,002,888.88               |

|                     |                                  |                                  |
|---------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 报告期间申购/买入总份额        | -                                | -                                |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                                | -                                |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                                | -                                |
| 报告期末持有的基金份额         | -                                | 10,002,888.88                    |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                                | 25.14%                           |
| 项目                  | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|                     | 泰信低碳经济混合发起式 A                    | 泰信低碳经济混合发起式 C                    |
| 报告期初持有的基金份额         | -                                | 10,002,888.88                    |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                                | -                                |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                                | -                                |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                                | -                                |
| 报告期末持有的基金份额         | -                                | 10,002,888.88                    |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                                | 21.28%                           |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 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<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |           |
|-------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                        | 当期利息收入    | 期末余额                             | 当期利息收入    |
| 南京银行  | 2,698,461.32                | 13,215.24 | 3,265,992.98                     | 29,098.33 |

注：本基金的银行存款由基金托管人南京银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 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无其他关联交易事项的说明。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配的情况。

#### 7.4.12 期末（2023 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末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

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临的各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设审计、合规与风险控制委员会、督察长、监察稽核部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的货币资金存放于本基金的基金托管人南京银行，与该货币资金相关的信用风险不重大。本基金在证券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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信

用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法对投资者赎回款或基金其它应付款按时支付的风险。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的金融负债的合同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（净资产）无固定到期日且不计息。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

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该比例限制）。

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。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 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

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 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为人民币 23,260,151.52 元，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。

#### 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，包括利率风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是货币资金、债券投资。利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计            |
|-------------------------|--------------|-------|-------|----------------|---------------|
| 资产                      |              |       |       |                |               |
| 货币资金                    | 2,698,461.32 | -     | -     | -              | 2,698,461.32  |
| 结算备付金                   | 307,899.96   | -     | -     | -              | 307,899.96    |
| 存出保证金                   | 93,817.07    | -     | -     | -              | 93,817.07     |
| 交易性金融资产                 | -            | -     | -     | -20,428,701.29 | 20,428,701.29 |
| 应收申购款                   | -            | -     | -     | 619.67         | 619.67        |
| 应收清算款                   | -            | -     | -     | 153,866.19     | 153,866.19    |
| 资产总计                    | 3,100,178.35 | -     | -     | -20,583,187.15 | 23,683,365.50 |
| 负债                      |              |       |       |                |               |

|                          |              |   |   |                |               |
|--------------------------|--------------|---|---|----------------|---------------|
| 应付赎回款                    | -            | - | - | 21,217.45      | 21,217.45     |
| 应付管理人报酬                  | -            | - | - | 22,883.42      | 22,883.42     |
| 应付托管费                    | -            | - | - | 3,813.90       | 3,813.90      |
| 应付清算款                    | -            | - | - | 854,061.74     | 854,061.74    |
| 应付销售服务费                  | -            | - | - | 5,856.09       | 5,856.09      |
| 其他负债                     | -            | - | - | 222,342.65     | 222,342.65    |
| 负债总计                     | -            | - | - | 1,130,175.25   | 1,130,175.25  |
| 利率敏感度缺口                  | 3,100,178.35 | - | - | -19,453,011.90 | 22,553,190.25 |
| 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |              |   |   |                |               |
| 资产                       |              |   |   |                |               |
| 货币资金                     | 3,265,992.98 | - | - | -              | 3,265,992.98  |
| 结算备付金                    | 523,802.80   | - | - | -              | 523,802.80    |
| 存出保证金                    | 107,003.98   | - | - | -              | 107,003.98    |
| 交易性金融资产                  | -            | - | - | -28,535,231.24 | 28,535,231.24 |
| 应收申购款                    | -            | - | - | 3,537.99       | 3,537.99      |
| 应收清算款                    | -            | - | - | 16,777.49      | 16,777.49     |
| 资产总计                     | 3,896,799.76 | - | - | -28,555,546.72 | 32,452,346.48 |
| 负债                       |              |   |   |                |               |
| 应付赎回款                    | -            | - | - | 3,761.34       | 3,761.34      |
| 应付管理人报酬                  | -            | - | - | 41,804.89      | 41,804.89     |
| 应付托管费                    | -            | - | - | 6,967.47       | 6,967.47      |
| 应付销售服务费                  | -            | - | - | 8,499.59       | 8,499.59      |
| 其他负债                     | -            | - | - | 333,381.23     | 333,381.23    |
| 负债总计                     | -            | - | - | 394,414.52     | 394,414.52    |
| 利率敏感度缺口                  | 3,896,799.76 | - | - | -28,161,132.20 | 32,057,931.96 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 |                   | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|-------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 20,428,701.29           | 90.58             | 28,535,231.24            | 89.01             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                       | -                 | -                        | -                 |
| 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            | 20,428,701.29           | 90.58             | 28,535,231.24            | 89.01             |

#### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 本基金业绩比较基准变化 5%，其他变量不变 |                                 |                        |
|----|-----------------------|---------------------------------|------------------------|
| 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                       | 本期末（2023 年 12 月 31 日）           | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 业绩比较基准上升 5%        | 828,373.70                      | 1,694,460.18           |
|    | 2. 业绩比较基准下降 5%        | -828,373.70                     | -1,694,460.18          |

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

#### 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。

##### 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

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 20,428,701.29           | 28,535,231.24            |
| 第二层次          | -                       | -                        |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 20,428,701.29           | 28,535,231.24            |

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期末及上年度末无第三层次公允价值余额及变动情况。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

#### 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资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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   | 20,428,701.29 | 86.26         |
|    | 其中：股票  | 20,428,701.29 | 86.26         |
| 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      | 3,006,361.28  | 12.69  |
| 8 | 其他各项资产            | 248,302.93    | 1.05   |
| 9 | 合计                | 23,683,365.50 | 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

金额单位：人民币元

| 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              | 14,809,601.91 | 65.67        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,115,652.00  | 4.95         |
| E  | 建筑业              | 460,000.00    | 2.04         |
| 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  | 2,455,577.38  | 10.89        |
| 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       | 1,400,853.00  | 6.21         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 187,017.00    | 0.83         |
| 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               | 20,428,701.29 | 90.58        |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未持有港股通股票。

## 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  | 300394 | 天孚通信 | 15,400 | 1,409,408.00 | 6.25 |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 11,900 | 1,343,629.00 | 5.96 |
| 3  | 300765 | 新诺威  | 35,000 | 1,281,700.00 | 5.68 |
| 4  | 688301 | 奕瑞科技 | 3,825  | 1,244,119.50 | 5.52 |
| 5  | 600900 | 长江电力 | 47,800 | 1,115,652.00 | 4.95 |
| 6  | 688025 | 杰普特  | 11,556 | 1,069,507.80 | 4.74 |
| 7  | 300081 | 恒信东方 | 81,700 | 943,635.00   | 4.18 |
| 8  | 300751 | 迈为股份 | 7,200  | 932,472.00   | 4.13 |
| 9  | 688328 | 深科达  | 19,308 | 865,963.80   | 3.84 |
| 10 | 300049 | 福瑞股份 | 19,800 | 863,082.00   | 3.83 |
| 11 | 600775 | 南京熊猫 | 56,800 | 752,600.00   | 3.34 |
| 12 | 688590 | 新致软件 | 32,104 | 726,192.48   | 3.22 |
| 13 | 688266 | 泽璟制药 | 11,640 | 616,221.60   | 2.73 |
| 14 | 688177 | 百奥泰  | 14,370 | 592,618.80   | 2.63 |
| 15 | 300264 | 佳创视讯 | 62,700 | 514,767.00   | 2.28 |
| 16 | 000625 | 长安汽车 | 30,065 | 505,993.95   | 2.24 |
| 17 | 688687 | 凯因科技 | 14,327 | 499,439.22   | 2.21 |
| 18 | 605289 | 罗曼股份 | 8,000  | 460,000.00   | 2.04 |
| 19 | 300492 | 华图山鼎 | 5,400  | 457,218.00   | 2.03 |
| 20 | 000810 | 创维数字 | 26,400 | 414,744.00   | 1.84 |
| 21 | 300459 | 汤姆猫  | 73,400 | 362,596.00   | 1.61 |
| 22 | 301312 | 智立方  | 2,800  | 303,352.00   | 1.35 |
| 23 | 300705 | 九典制药 | 9,000  | 299,070.00   | 1.33 |
| 24 | 688115 | 思林杰  | 8,479  | 293,966.93   | 1.30 |
| 25 | 688111 | 金山办公 | 800    | 252,960.00   | 1.12 |
| 26 | 688543 | 国科军工 | 4,210  | 235,339.00   | 1.04 |
| 27 | 600602 | 云赛智联 | 18,300 | 211,731.00   | 0.94 |
| 28 | 300115 | 长盈精密 | 15,900 | 210,675.00   | 0.93 |
| 29 | 002717 | 岭南股份 | 57,900 | 187,017.00   | 0.83 |
| 30 | 601138 | 工业富联 | 12,100 | 182,952.00   | 0.81 |
| 31 | 603688 | 石英股份 | 2,100  | 182,448.00   | 0.81 |
| 32 | 688608 | 恒玄科技 | 1,153  | 177,873.31   | 0.79 |
| 33 | 688095 | 福昕软件 | 2,454  | 171,411.90   | 0.76 |
| 34 | 300693 | 盛弘股份 | 4,900  | 146,559.00   | 0.65 |
| 35 | 600418 | 江淮汽车 | 7,200  | 116,280.00   | 0.52 |
| 36 | 002315 | 焦点科技 | 3,500  | 115,955.00   | 0.51 |
| 37 | 003021 | 兆威机电 | 1,000  | 93,990.00    | 0.42 |
| 38 | 300418 | 昆仑万维 | 2,300  | 86,020.00    | 0.38 |
| 39 | 300812 | 易天股份 | 1,900  | 79,021.00    | 0.35 |
| 40 | 002156 | 通富微电 | 2,600  | 60,112.00    | 0.27 |
| 41 | 300573 | 兴齐眼药 | 200    | 36,464.00    | 0.16 |
| 42 | 301316 | 慧博云通 | 600    | 13,944.00    | 0.06 |

## 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  | 601138 | 工业富联 | 6,837,905.00 | 21.33          |
| 2  | 000977 | 浪潮信息 | 6,231,249.00 | 19.44          |
| 3  | 300308 | 中际旭创 | 4,633,598.00 | 14.45          |
| 4  | 300624 | 万兴科技 | 4,552,144.00 | 14.20          |
| 5  | 603688 | 石英股份 | 4,328,668.00 | 13.50          |
| 6  | 300068 | 南都电源 | 4,293,972.62 | 13.39          |
| 7  | 600266 | 城建发展 | 3,987,125.10 | 12.44          |
| 8  | 688111 | 金山办公 | 3,783,751.06 | 11.80          |
| 9  | 300502 | 新易盛  | 3,728,462.00 | 11.63          |
| 10 | 601877 | 正泰电器 | 3,682,312.00 | 11.49          |
| 11 | 300476 | 胜宏科技 | 3,620,821.00 | 11.29          |
| 12 | 600602 | 云赛智联 | 3,540,686.00 | 11.04          |
| 13 | 300394 | 天孚通信 | 3,345,100.00 | 10.43          |
| 14 | 300459 | 汤姆猫  | 3,098,951.00 | 9.67           |
| 15 | 300049 | 福瑞股份 | 2,910,456.00 | 9.08           |
| 16 | 601360 | 三六零  | 2,795,938.39 | 8.72           |
| 17 | 000568 | 泸州老窖 | 2,783,745.00 | 8.68           |
| 18 | 002174 | 游族网络 | 2,769,469.00 | 8.64           |
| 19 | 000625 | 长安汽车 | 2,682,243.00 | 8.37           |
| 20 | 000858 | 五粮液  | 2,677,518.00 | 8.35           |
| 21 | 300570 | 太辰光  | 2,677,080.00 | 8.35           |
| 22 | 002315 | 焦点科技 | 2,646,820.00 | 8.26           |
| 23 | 300118 | 东方日升 | 2,458,375.00 | 7.67           |
| 24 | 002812 | 恩捷股份 | 2,319,017.00 | 7.23           |
| 25 | 603000 | 人民网  | 2,292,108.00 | 7.15           |
| 26 | 688025 | 杰普特  | 2,285,088.47 | 7.13           |
| 27 | 688072 | 拓荆科技 | 2,261,393.44 | 7.05           |
| 28 | 688590 | 新致软件 | 2,212,343.62 | 6.90           |
| 29 | 002920 | 德赛西威 | 2,199,622.00 | 6.86           |
| 30 | 600900 | 长江电力 | 2,180,794.00 | 6.80           |
| 31 | 000090 | 天健集团 | 2,173,537.00 | 6.78           |
| 32 | 688256 | 寒武纪  | 2,165,726.39 | 6.76           |
| 33 | 300393 | 中来股份 | 2,134,856.00 | 6.66           |
| 34 | 300002 | 神州泰岳 | 2,077,928.00 | 6.48           |
| 35 | 300418 | 昆仑万维 | 2,069,559.00 | 6.46           |
| 36 | 002335 | 科华数据 | 2,032,795.00 | 6.34           |
| 37 | 002351 | 漫步者  | 1,995,370.00 | 6.22           |
| 38 | 600325 | 华发股份 | 1,994,209.00 | 6.22           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 39 | 300525 | 博思软件 | 1,986,663.00 | 6.20 |
| 40 | 002230 | 科大讯飞 | 1,967,958.00 | 6.14 |
| 41 | 300982 | 苏文电能 | 1,912,290.00 | 5.97 |
| 42 | 600775 | 南京熊猫 | 1,865,958.00 | 5.82 |
| 43 | 300031 | 宝通科技 | 1,762,377.00 | 5.50 |
| 44 | 300364 | 中文在线 | 1,749,938.00 | 5.46 |
| 45 | 002860 | 星帅尔  | 1,731,765.56 | 5.40 |
| 46 | 300751 | 迈为股份 | 1,728,410.96 | 5.39 |
| 47 | 600779 | 水井坊  | 1,707,891.24 | 5.33 |
| 48 | 300274 | 阳光电源 | 1,689,781.00 | 5.27 |
| 49 | 300263 | 隆华科技 | 1,662,593.00 | 5.19 |
| 50 | 300081 | 恒信东方 | 1,660,322.00 | 5.18 |
| 51 | 600079 | 人福医药 | 1,617,400.00 | 5.05 |
| 52 | 002244 | 滨江集团 | 1,598,483.00 | 4.99 |
| 53 | 688248 | 南网科技 | 1,591,749.64 | 4.97 |
| 54 | 605117 | 德业股份 | 1,578,730.00 | 4.92 |
| 55 | 301168 | 通灵股份 | 1,554,195.00 | 4.85 |
| 56 | 688531 | 日联科技 | 1,541,899.61 | 4.81 |
| 57 | 002045 | 国光电器 | 1,535,287.00 | 4.79 |
| 58 | 601059 | 信达证券 | 1,528,930.00 | 4.77 |
| 59 | 002865 | 钧达股份 | 1,510,856.00 | 4.71 |
| 60 | 600131 | 国网信通 | 1,505,886.00 | 4.70 |
| 61 | 300693 | 盛弘股份 | 1,490,750.00 | 4.65 |
| 62 | 688658 | 悦康药业 | 1,490,596.73 | 4.65 |
| 63 | 688498 | 源杰科技 | 1,488,716.30 | 4.64 |
| 64 | 603686 | 福龙马  | 1,476,380.00 | 4.61 |
| 65 | 603369 | 今世缘  | 1,465,938.00 | 4.57 |
| 66 | 603806 | 福斯特  | 1,460,249.00 | 4.56 |
| 67 | 000810 | 创维数字 | 1,454,292.00 | 4.54 |
| 68 | 300130 | 新国都  | 1,449,207.00 | 4.52 |
| 69 | 688195 | 腾景科技 | 1,442,533.08 | 4.50 |
| 70 | 300765 | 新诺威  | 1,427,877.00 | 4.45 |
| 71 | 002558 | 巨人网络 | 1,416,325.00 | 4.42 |
| 72 | 300724 | 捷佳伟创 | 1,386,413.00 | 4.32 |
| 73 | 002236 | 大华股份 | 1,383,381.00 | 4.32 |
| 74 | 002271 | 东方雨虹 | 1,381,765.00 | 4.31 |
| 75 | 600702 | 舍得酒业 | 1,363,365.00 | 4.25 |
| 76 | 688032 | 禾迈股份 | 1,363,094.83 | 4.25 |
| 77 | 300426 | 唐德影视 | 1,288,653.00 | 4.02 |
| 78 | 601900 | 南方传媒 | 1,282,330.00 | 4.00 |
| 79 | 600418 | 江淮汽车 | 1,260,181.00 | 3.93 |
| 80 | 601728 | 中国电信 | 1,259,607.00 | 3.93 |
| 81 | 002126 | 银轮股份 | 1,258,484.00 | 3.93 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 82  | 300493 | 润欣科技 | 1,239,429.00 | 3.87 |
| 83  | 002582 | 好想你  | 1,225,138.00 | 3.82 |
| 84  | 300015 | 爱尔眼科 | 1,223,285.00 | 3.82 |
| 85  | 603108 | 润达医疗 | 1,222,834.00 | 3.81 |
| 86  | 688166 | 博瑞医药 | 1,210,476.58 | 3.78 |
| 87  | 603019 | 中科曙光 | 1,203,448.00 | 3.75 |
| 88  | 600649 | 城投控股 | 1,189,083.00 | 3.71 |
| 89  | 688668 | 鼎通科技 | 1,187,866.01 | 3.71 |
| 90  | 688390 | 固德威  | 1,178,858.90 | 3.68 |
| 91  | 300559 | 佳发教育 | 1,173,820.00 | 3.66 |
| 92  | 603997 | 继峰股份 | 1,168,955.04 | 3.65 |
| 93  | 300548 | 博创科技 | 1,160,372.00 | 3.62 |
| 94  | 001979 | 招商蛇口 | 1,154,100.00 | 3.60 |
| 95  | 002156 | 通富微电 | 1,152,171.00 | 3.59 |
| 96  | 002965 | 祥鑫科技 | 1,149,336.00 | 3.59 |
| 97  | 002371 | 北方华创 | 1,142,639.00 | 3.56 |
| 98  | 601901 | 方正证券 | 1,137,677.34 | 3.55 |
| 99  | 300264 | 佳创视讯 | 1,114,332.00 | 3.48 |
| 100 | 601198 | 东兴证券 | 1,111,053.00 | 3.47 |
| 101 | 002819 | 东方中科 | 1,109,811.00 | 3.46 |
| 102 | 600277 | 亿利洁能 | 1,098,546.00 | 3.43 |
| 103 | 002709 | 天赐材料 | 1,088,700.00 | 3.40 |
| 104 | 300566 | 激智科技 | 1,088,330.00 | 3.39 |
| 105 | 002821 | 凯莱英  | 1,085,345.00 | 3.39 |
| 106 | 002472 | 双环传动 | 1,081,301.00 | 3.37 |
| 107 | 300058 | 蓝色光标 | 1,080,804.00 | 3.37 |
| 108 | 000657 | 中钨高新 | 1,078,853.00 | 3.37 |
| 109 | 300679 | 电连技术 | 1,078,064.00 | 3.36 |
| 110 | 002555 | 三七互娱 | 1,070,474.00 | 3.34 |
| 111 | 300413 | 芒果超媒 | 1,070,438.00 | 3.34 |
| 112 | 601929 | 吉视传媒 | 1,059,850.00 | 3.31 |
| 113 | 000651 | 格力电器 | 1,051,195.00 | 3.28 |
| 114 | 002459 | 晶澳科技 | 1,045,645.96 | 3.26 |
| 115 | 002122 | 汇洲智能 | 1,041,402.00 | 3.25 |
| 116 | 300014 | 亿纬锂能 | 1,031,030.00 | 3.22 |
| 117 | 601595 | 上海电影 | 1,024,522.00 | 3.20 |
| 118 | 002623 | 亚玛顿  | 1,024,461.00 | 3.20 |
| 119 | 300315 | 掌趣科技 | 1,015,317.64 | 3.17 |
| 120 | 300620 | 光库科技 | 1,002,039.00 | 3.13 |
| 121 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,001,588.52 | 3.12 |
| 122 | 300841 | 康华生物 | 1,001,388.00 | 3.12 |
| 123 | 688076 | 诺泰生物 | 999,371.20   | 3.12 |
| 124 | 301267 | 华夏眼科 | 987,425.00   | 3.08 |

|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 125 | 002463 | 沪电股份 | 986,168.00 | 3.08 |
| 126 | 002238 | 天威视讯 | 981,149.00 | 3.06 |
| 127 | 603801 | 志邦家居 | 977,422.00 | 3.05 |
| 128 | 300454 | 深信服  | 970,990.00 | 3.03 |
| 129 | 601155 | 新城控股 | 968,686.00 | 3.02 |
| 130 | 300750 | 宁德时代 | 960,552.00 | 3.00 |
| 131 | 300344 | 立方数科 | 953,499.00 | 2.97 |
| 132 | 601865 | 福莱特  | 942,054.00 | 2.94 |
| 133 | 603105 | 芯能科技 | 939,774.00 | 2.93 |
| 134 | 601136 | 首创证券 | 938,274.00 | 2.93 |
| 135 | 300396 | 迪瑞医疗 | 935,487.00 | 2.92 |
| 136 | 300568 | 星源材质 | 927,535.00 | 2.89 |
| 137 | 600557 | 康缘药业 | 926,771.00 | 2.89 |
| 138 | 603918 | 金桥信息 | 920,704.00 | 2.87 |
| 139 | 603198 | 迎驾贡酒 | 916,497.00 | 2.86 |
| 140 | 002317 | 众生药业 | 900,933.00 | 2.81 |
| 141 | 600388 | 龙净环保 | 898,323.00 | 2.80 |
| 142 | 603305 | 旭升集团 | 890,177.00 | 2.78 |
| 143 | 300122 | 智飞生物 | 889,701.00 | 2.78 |
| 144 | 688036 | 传音控股 | 886,929.63 | 2.77 |
| 145 | 300573 | 兴齐眼药 | 884,840.00 | 2.76 |
| 146 | 688088 | 虹软科技 | 878,998.36 | 2.74 |
| 147 | 300812 | 易天股份 | 875,430.00 | 2.73 |
| 148 | 688212 | 澳华内镜 | 873,603.28 | 2.73 |
| 149 | 600475 | 华光环能 | 873,569.00 | 2.72 |
| 150 | 600633 | 浙数文化 | 871,310.00 | 2.72 |
| 151 | 300085 | 银之杰  | 863,005.00 | 2.69 |
| 152 | 002291 | 遥望科技 | 854,324.00 | 2.66 |
| 153 | 688328 | 深科达  | 852,854.13 | 2.66 |
| 154 | 000676 | 智度股份 | 849,197.00 | 2.65 |
| 155 | 002857 | 三晖电气 | 846,230.00 | 2.64 |
| 156 | 603283 | 赛腾股份 | 842,431.00 | 2.63 |
| 157 | 688266 | 泽璟制药 | 834,383.87 | 2.60 |
| 158 | 300133 | 华策影视 | 828,442.00 | 2.58 |
| 159 | 002777 | 久远银海 | 821,376.00 | 2.56 |
| 160 | 000661 | 长春高新 | 810,213.00 | 2.53 |
| 161 | 000400 | 许继电气 | 801,590.00 | 2.50 |
| 162 | 002292 | 奥飞娱乐 | 798,684.00 | 2.49 |
| 163 | 600733 | 北汽蓝谷 | 793,492.00 | 2.48 |
| 164 | 688646 | 逸飞激光 | 793,212.85 | 2.47 |
| 165 | 000988 | 华工科技 | 791,157.00 | 2.47 |
| 166 | 600329 | 达仁堂  | 786,815.00 | 2.45 |
| 167 | 688443 | 智翔金泰 | 778,743.74 | 2.43 |

|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 168 | 600422 | 昆药集团 | 767,475.00 | 2.39 |
| 169 | 600819 | 耀皮玻璃 | 760,230.00 | 2.37 |
| 170 | 002334 | 英威腾  | 759,506.00 | 2.37 |
| 171 | 001896 | 豫能控股 | 757,318.00 | 2.36 |
| 172 | 002192 | 融捷股份 | 750,955.00 | 2.34 |
| 173 | 603258 | 电魂网络 | 749,517.00 | 2.34 |
| 174 | 603833 | 欧派家居 | 741,649.00 | 2.31 |
| 175 | 688235 | 百济神州 | 740,015.61 | 2.31 |
| 176 | 688609 | 九联科技 | 734,709.34 | 2.29 |
| 177 | 002738 | 中矿资源 | 734,687.00 | 2.29 |
| 178 | 002675 | 东诚药业 | 731,389.24 | 2.28 |
| 179 | 002223 | 鱼跃医疗 | 731,263.40 | 2.28 |
| 180 | 600640 | 国脉文化 | 718,471.00 | 2.24 |
| 181 | 600129 | 太极集团 | 709,238.00 | 2.21 |
| 182 | 688095 | 福昕软件 | 705,893.23 | 2.20 |
| 183 | 600189 | 泉阳泉  | 691,532.00 | 2.16 |
| 184 | 688630 | 芯碁微装 | 680,834.86 | 2.12 |
| 185 | 688435 | 英方软件 | 667,154.12 | 2.08 |
| 186 | 002559 | 亚威股份 | 664,564.00 | 2.07 |
| 187 | 688687 | 凯因科技 | 657,363.89 | 2.05 |
| 188 | 603496 | 恒为科技 | 642,292.60 | 2.00 |

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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  | 601138 | 工业富联 | 6,483,101.00 | 20.22          |
| 2  | 000977 | 浪潮信息 | 5,742,718.00 | 17.91          |
| 3  | 300624 | 万兴科技 | 5,130,398.00 | 16.00          |
| 4  | 603688 | 石英股份 | 4,916,124.85 | 15.34          |
| 5  | 300476 | 胜宏科技 | 4,060,336.92 | 12.67          |
| 6  | 300068 | 南都电源 | 4,019,261.36 | 12.54          |
| 7  | 600266 | 城建发展 | 3,878,809.00 | 12.10          |
| 8  | 601877 | 正泰电器 | 3,545,845.00 | 11.06          |
| 9  | 688111 | 金山办公 | 3,507,173.24 | 10.94          |
| 10 | 600602 | 云赛智联 | 3,420,112.00 | 10.67          |
| 11 | 300502 | 新易盛  | 3,402,595.00 | 10.61          |
| 12 | 300308 | 中际旭创 | 3,343,488.89 | 10.43          |
| 13 | 000858 | 五粮液  | 3,173,426.18 | 9.90           |
| 14 | 603806 | 福斯特  | 3,144,960.20 | 9.81           |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 3,117,507.60 | 9.72           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 16 | 688072 | 拓荆科技 | 3,080,380.47 | 9.61 |
| 17 | 300274 | 阳光电源 | 2,968,883.71 | 9.26 |
| 18 | 601360 | 三六零  | 2,876,544.00 | 8.97 |
| 19 | 002315 | 焦点科技 | 2,824,089.00 | 8.81 |
| 20 | 300459 | 汤姆猫  | 2,800,254.00 | 8.73 |
| 21 | 300570 | 太辰光  | 2,664,100.00 | 8.31 |
| 22 | 300394 | 天孚通信 | 2,663,885.00 | 8.31 |
| 23 | 002174 | 游族网络 | 2,616,184.00 | 8.16 |
| 24 | 688256 | 寒武纪  | 2,568,244.76 | 8.01 |
| 25 | 300118 | 东方日升 | 2,466,556.12 | 7.69 |
| 26 | 603000 | 人民网  | 2,383,788.00 | 7.44 |
| 27 | 300049 | 福瑞股份 | 2,294,590.00 | 7.16 |
| 28 | 002812 | 恩捷股份 | 2,210,889.00 | 6.90 |
| 29 | 300418 | 昆仑万维 | 2,207,881.00 | 6.89 |
| 30 | 300002 | 神州泰岳 | 2,187,631.00 | 6.82 |
| 31 | 000090 | 天健集团 | 2,146,854.00 | 6.70 |
| 32 | 000625 | 长安汽车 | 2,126,964.50 | 6.63 |
| 33 | 002920 | 德赛西威 | 2,049,658.00 | 6.39 |
| 34 | 688560 | 明冠新材 | 2,019,392.93 | 6.30 |
| 35 | 002351 | 漫步者  | 1,963,524.00 | 6.12 |
| 36 | 002335 | 科华数据 | 1,935,333.19 | 6.04 |
| 37 | 300525 | 博思软件 | 1,929,276.00 | 6.02 |
| 38 | 300393 | 中来股份 | 1,902,705.00 | 5.94 |
| 39 | 600325 | 华发股份 | 1,869,708.00 | 5.83 |
| 40 | 300982 | 苏文电能 | 1,862,049.00 | 5.81 |
| 41 | 002230 | 科大讯飞 | 1,836,299.00 | 5.73 |
| 42 | 688590 | 新致软件 | 1,757,366.96 | 5.48 |
| 43 | 600329 | 达仁堂  | 1,751,747.76 | 5.46 |
| 44 | 002238 | 天威视讯 | 1,731,957.00 | 5.40 |
| 45 | 002459 | 晶澳科技 | 1,730,276.10 | 5.40 |
| 46 | 002865 | 钧达股份 | 1,723,989.00 | 5.38 |
| 47 | 301391 | 卡莱特  | 1,698,959.00 | 5.30 |
| 48 | 300438 | 鹏辉能源 | 1,675,676.30 | 5.23 |
| 49 | 605117 | 德业股份 | 1,665,792.80 | 5.20 |
| 50 | 600779 | 水井坊  | 1,660,098.00 | 5.18 |
| 51 | 300364 | 中文在线 | 1,623,043.00 | 5.06 |
| 52 | 300031 | 宝通科技 | 1,612,220.00 | 5.03 |
| 53 | 002860 | 星帅尔  | 1,607,489.62 | 5.01 |
| 54 | 600131 | 国网信通 | 1,600,640.00 | 4.99 |
| 55 | 002244 | 滨江集团 | 1,597,329.00 | 4.98 |
| 56 | 603369 | 今世缘  | 1,562,979.00 | 4.88 |
| 57 | 600079 | 人福医药 | 1,538,737.00 | 4.80 |
| 58 | 600522 | 中天科技 | 1,498,505.00 | 4.67 |



|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 59  | 601059 | 信达证券 | 1,496,642.00 | 4.67 |
| 60  | 300573 | 兴齐眼药 | 1,496,296.00 | 4.67 |
| 61  | 002558 | 巨人网络 | 1,472,242.99 | 4.59 |
| 62  | 603686 | 福龙马  | 1,457,568.00 | 4.55 |
| 63  | 601900 | 南方传媒 | 1,451,882.00 | 4.53 |
| 64  | 300130 | 新国都  | 1,444,485.00 | 4.51 |
| 65  | 300750 | 宁德时代 | 1,438,400.04 | 4.49 |
| 66  | 002965 | 祥鑫科技 | 1,416,809.40 | 4.42 |
| 67  | 688516 | 奥特维  | 1,414,820.93 | 4.41 |
| 68  | 300263 | 隆华科技 | 1,414,296.00 | 4.41 |
| 69  | 688195 | 腾景科技 | 1,406,026.36 | 4.39 |
| 70  | 600702 | 舍得酒业 | 1,403,032.00 | 4.38 |
| 71  | 688498 | 源杰科技 | 1,400,436.98 | 4.37 |
| 72  | 002236 | 大华股份 | 1,386,629.00 | 4.33 |
| 73  | 002045 | 国光电器 | 1,384,302.00 | 4.32 |
| 74  | 688025 | 杰普特  | 1,371,682.21 | 4.28 |
| 75  | 688531 | 日联科技 | 1,355,668.76 | 4.23 |
| 76  | 300724 | 捷佳伟创 | 1,325,136.00 | 4.13 |
| 77  | 688166 | 博瑞医药 | 1,316,699.95 | 4.11 |
| 78  | 301168 | 通灵股份 | 1,314,354.00 | 4.10 |
| 79  | 002126 | 银轮股份 | 1,298,459.00 | 4.05 |
| 80  | 601728 | 中国电信 | 1,297,772.00 | 4.05 |
| 81  | 002271 | 东方雨虹 | 1,260,880.00 | 3.93 |
| 82  | 688120 | 华海清科 | 1,260,787.79 | 3.93 |
| 83  | 688248 | 南网科技 | 1,256,868.13 | 3.92 |
| 84  | 688658 | 悦康药业 | 1,251,822.40 | 3.90 |
| 85  | 300493 | 润欣科技 | 1,246,413.00 | 3.89 |
| 86  | 688381 | 帝奥微  | 1,236,838.96 | 3.86 |
| 87  | 603019 | 中科曙光 | 1,234,804.00 | 3.85 |
| 88  | 300058 | 蓝色光标 | 1,228,862.00 | 3.83 |
| 89  | 603108 | 润达医疗 | 1,198,235.00 | 3.74 |
| 90  | 601595 | 上海电影 | 1,188,091.00 | 3.71 |
| 91  | 300559 | 佳发教育 | 1,179,859.00 | 3.68 |
| 92  | 300426 | 唐德影视 | 1,172,759.00 | 3.66 |
| 93  | 001979 | 招商蛇口 | 1,159,309.00 | 3.62 |
| 94  | 688668 | 鼎通科技 | 1,149,286.46 | 3.59 |
| 95  | 002518 | 科士达  | 1,145,146.48 | 3.57 |
| 96  | 002582 | 好想你  | 1,145,083.00 | 3.57 |
| 97  | 600649 | 城投控股 | 1,130,130.00 | 3.53 |
| 98  | 300015 | 爱尔眼科 | 1,128,705.00 | 3.52 |
| 99  | 000651 | 格力电器 | 1,127,450.00 | 3.52 |
| 100 | 002821 | 凯莱英  | 1,126,950.00 | 3.52 |
| 101 | 603997 | 继峰股份 | 1,126,023.00 | 3.51 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 102 | 002371 | 北方华创 | 1,117,719.00 | 3.49 |
| 103 | 600418 | 江淮汽车 | 1,112,005.00 | 3.47 |
| 104 | 600277 | 亿利洁能 | 1,108,790.00 | 3.46 |
| 105 | 002156 | 通富微电 | 1,099,953.00 | 3.43 |
| 106 | 600900 | 长江电力 | 1,095,662.00 | 3.42 |
| 107 | 300413 | 芒果超媒 | 1,094,624.00 | 3.41 |
| 108 | 000810 | 创维数字 | 1,094,044.00 | 3.41 |
| 109 | 601198 | 东兴证券 | 1,088,958.00 | 3.40 |
| 110 | 688099 | 晶晨股份 | 1,082,611.06 | 3.38 |
| 111 | 002472 | 双环传动 | 1,069,900.00 | 3.34 |
| 112 | 300679 | 电连技术 | 1,066,401.00 | 3.33 |
| 113 | 300566 | 激智科技 | 1,062,338.00 | 3.31 |
| 114 | 688390 | 固德威  | 1,057,274.71 | 3.30 |
| 115 | 002819 | 东方中科 | 1,044,918.00 | 3.26 |
| 116 | 002555 | 三七互娱 | 1,042,167.00 | 3.25 |
| 117 | 300548 | 博创科技 | 1,041,833.92 | 3.25 |
| 118 | 002709 | 天赐材料 | 1,034,153.00 | 3.23 |
| 119 | 603198 | 迎驾贡酒 | 1,033,275.00 | 3.22 |
| 120 | 000657 | 中钨高新 | 1,033,061.00 | 3.22 |
| 121 | 688032 | 禾迈股份 | 1,026,161.41 | 3.20 |
| 122 | 601901 | 方正证券 | 1,015,384.00 | 3.17 |
| 123 | 601929 | 吉视传媒 | 1,005,560.00 | 3.14 |
| 124 | 300693 | 盛弘股份 | 995,976.00   | 3.11 |
| 125 | 300315 | 掌趣科技 | 983,328.00   | 3.07 |
| 126 | 603283 | 赛腾股份 | 976,716.00   | 3.05 |
| 127 | 601155 | 新城控股 | 954,170.59   | 2.98 |
| 128 | 300454 | 深信服  | 952,888.00   | 2.97 |
| 129 | 688076 | 诺泰生物 | 946,222.86   | 2.95 |
| 130 | 301267 | 华夏眼科 | 945,018.00   | 2.95 |
| 131 | 601136 | 首创证券 | 942,802.00   | 2.94 |
| 132 | 600775 | 南京熊猫 | 942,060.00   | 2.94 |
| 133 | 002623 | 亚玛顿  | 940,592.00   | 2.93 |
| 134 | 300122 | 智飞生物 | 939,843.00   | 2.93 |
| 135 | 300620 | 光库科技 | 937,011.00   | 2.92 |
| 136 | 300014 | 亿纬锂能 | 932,939.00   | 2.91 |
| 137 | 688212 | 澳华内镜 | 916,117.87   | 2.86 |
| 138 | 603801 | 志邦家居 | 912,470.40   | 2.85 |
| 139 | 002463 | 沪电股份 | 910,672.00   | 2.84 |
| 140 | 002559 | 亚威股份 | 908,102.50   | 2.83 |
| 141 | 002122 | 汇洲智能 | 906,765.00   | 2.83 |
| 142 | 300568 | 星源材质 | 901,307.28   | 2.81 |
| 143 | 603305 | 旭升集团 | 894,382.00   | 2.79 |
| 144 | 601865 | 福莱特  | 894,319.00   | 2.79 |

|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 145 | 600557 | 康缘药业 | 886,745.00 | 2.77 |
| 146 | 600475 | 华光环能 | 882,901.00 | 2.75 |
| 147 | 002334 | 英威腾  | 882,822.00 | 2.75 |
| 148 | 002317 | 众生药业 | 881,068.00 | 2.75 |
| 149 | 300396 | 迪瑞医疗 | 876,133.00 | 2.73 |
| 150 | 300841 | 康华生物 | 873,392.00 | 2.72 |
| 151 | 000400 | 许继电气 | 850,001.00 | 2.65 |
| 152 | 600633 | 浙数文化 | 843,529.00 | 2.63 |
| 153 | 002857 | 三晖电气 | 832,190.00 | 2.60 |
| 154 | 300812 | 易天股份 | 827,475.00 | 2.58 |
| 155 | 300344 | 立方数科 | 825,663.00 | 2.58 |
| 156 | 300133 | 华策影视 | 817,520.00 | 2.55 |
| 157 | 688088 | 虹软科技 | 814,311.99 | 2.54 |
| 158 | 688599 | 天合光能 | 812,823.33 | 2.54 |
| 159 | 688435 | 英方软件 | 806,144.78 | 2.51 |
| 160 | 000661 | 长春高新 | 805,967.00 | 2.51 |
| 161 | 603918 | 金桥信息 | 802,922.00 | 2.50 |
| 162 | 002291 | 遥望科技 | 800,469.00 | 2.50 |
| 163 | 300085 | 银之杰  | 797,282.00 | 2.49 |
| 164 | 600733 | 北汽蓝谷 | 791,975.00 | 2.47 |
| 165 | 000988 | 华工科技 | 785,006.00 | 2.45 |
| 166 | 300751 | 迈为股份 | 782,372.00 | 2.44 |
| 167 | 002675 | 东诚药业 | 779,766.00 | 2.43 |
| 168 | 603258 | 电魂网络 | 773,156.00 | 2.41 |
| 169 | 688036 | 传音控股 | 771,793.89 | 2.41 |
| 170 | 603105 | 芯能科技 | 770,244.00 | 2.40 |
| 171 | 000676 | 智度股份 | 769,861.00 | 2.40 |
| 172 | 002292 | 奥飞娱乐 | 763,792.00 | 2.38 |
| 173 | 600422 | 昆药集团 | 751,055.00 | 2.34 |
| 174 | 600388 | 龙净环保 | 748,619.00 | 2.34 |
| 175 | 300081 | 恒信东方 | 746,854.00 | 2.33 |
| 176 | 003022 | 联泓新科 | 746,000.00 | 2.33 |
| 177 | 600519 | 贵州茅台 | 739,602.00 | 2.31 |
| 178 | 001896 | 豫能控股 | 735,270.00 | 2.29 |
| 179 | 688008 | 澜起科技 | 735,235.90 | 2.29 |
| 180 | 603833 | 欧派家居 | 728,897.00 | 2.27 |
| 181 | 688630 | 芯碁微装 | 726,606.86 | 2.27 |
| 182 | 002192 | 融捷股份 | 719,677.00 | 2.24 |
| 183 | 002738 | 中矿资源 | 719,051.00 | 2.24 |
| 184 | 688235 | 百济神州 | 709,101.98 | 2.21 |
| 185 | 688646 | 逸飞激光 | 705,056.09 | 2.20 |
| 186 | 001314 | 亿道信息 | 703,853.00 | 2.20 |
| 187 | 002777 | 久远银海 | 701,622.00 | 2.19 |

|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 188 | 002223 | 鱼跃医疗 | 699,340.96 | 2.18 |
| 189 | 600640 | 国脉文化 | 691,164.00 | 2.16 |
| 190 | 688443 | 智翔金泰 | 690,159.07 | 2.15 |
| 191 | 300633 | 开立医疗 | 675,229.40 | 2.11 |
| 192 | 600200 | 江苏吴中 | 674,774.00 | 2.10 |
| 193 | 600129 | 太极集团 | 673,151.00 | 2.10 |
| 194 | 600189 | 泉阳泉  | 662,375.00 | 2.07 |
| 195 | 603118 | 共进股份 | 645,985.00 | 2.02 |
| 196 | 688609 | 九联科技 | 642,979.41 | 2.01 |

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

#### 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 | 346,734,974.82 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 350,805,156.73 |

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未持有债券。

#### 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

报告期末本基金未持有债券。

#### 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

报告期末本基金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

报告期末本基金未投资贵金属。

#### 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

报告期末本基金未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

本基金本报告期投资的前十名证券中发行主体未发生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、处罚的情况。

### 8.12.2 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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选库之外的股票。

### 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 | 93,817.07  |
| 2  | 应收清算款 | 153,866.19 |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 619.67     |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 248,302.93 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金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

报告期末本基金投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

## §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（%） |
| 泰信低碳经济混合发起式 A | 612      | 24,924.02 | 0.00  | 0.00      | 15,253,502.55 | 100.00    |

|               |       |           |               |       |               |       |
|---------------|-------|-----------|---------------|-------|---------------|-------|
| 泰信低碳经济混合发起式 C | 1,052 | 23,327.65 | 10,002,888.88 | 40.76 | 14,537,802.23 | 59.24 |
| 合计            | 1,664 | 23,914.78 | 10,002,888.88 | 25.14 | 29,791,304.78 | 74.86 |

## 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 | 泰信低碳经济混合发起式 A | 119,859.77 | 0.7858      |
|                  | 泰信低碳经济混合发起式 C | 10,102.16  | 0.0412      |
|                  | 合计            | 129,961.93 | 0.3266      |

## 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 | 泰信低碳经济混合发起式 A | 0                 |
|                                | 泰信低碳经济混合发起式 C | 0                 |
|                                | 合计            | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 泰信低碳经济混合发起式 A | 0                 |
|                                | 泰信低碳经济混合发起式 C | 0                 |
|                                | 合计            | 0                 |

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例（%） | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例（%） | 发起份额承诺持有期限        |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|-------------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,002,888.88 | 25.14           | 10,002,888.88 | 25.14           | 自基金合同生效之日起不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -               | -             | -               | -                 |
| 基金经理等人员     | -             | -               | -             | -               | -                 |
| 基金管理人股东     | -             | -               | -             | -               | -                 |
| 其他          | -             | -               | -             | -               | -                 |

|    |               |       |               |       |                   |
|----|---------------|-------|---------------|-------|-------------------|
| 合计 | 10,002,888.88 | 25.14 | 10,002,888.88 | 25.14 | 自基金合同生效之日起不少于 3 年 |
|----|---------------|-------|---------------|-------|-------------------|

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 泰信低碳经济混合发起式 A | 泰信低碳经济混合发起式 C |
|--|---------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2021 年 11 月 3 日)<br>基金份额总额 | 18,165,020.75 | 43,946,855.29 |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 18,165,757.45 | 28,837,638.18 |
| 本报告期基金总申购份额                            | 1,322,744.65  | 8,047,796.86  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | 4,234,999.55  | 12,344,743.93 |
| 本报告期基金拆分变动份额                           | -             | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 15,253,502.55 | 24,540,691.11 |

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额；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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

1、经泰信基金管理有限公司董事会审议通过，自 2023 年 8 月 23 日起，董事长李高峰先生代任公司总经理职务，高宇先生不再担任公司总经理职务。具体详情参见 2023 年 8 月 23 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。本公司上述人事变动已按相关规定进行备案。

2、2024 年 2 月 7 日，本基金托管人南京银行股份有限公司法定代表人变更为谢宁先生。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所审计费为人民币 3.00 万元。

#### 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

##### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

##### 11.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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 (%) |    |
| 广发证券 | 2      | 697,540,131.55 | 100.00           | 513,575.10 | 100.00         | -  |
| 国泰君安 | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）中关于“一家基金公司通过一家证券经营机构买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金 30%”的要求，本基金管理人在选择租用交易单元时，注重所选证券公司的综合实力、市场声誉。对证券公司的研究能力，由公司研究人员对其提供的研究报告、研究成果的质量进行定期评估。公司将根据内部评估报告，对交易单元租用情况进行总体评价，决定是否对交易单元租用情况进行调整。

2、本报告期新增交易单元：无；退租交易单元：无。

##### 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 |                  |
|------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
|      | 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 (%) |



|      |   |   |              |        |   |   |
|------|---|---|--------------|--------|---|---|
| 广发证券 | - | - | 3,500,000.00 | 100.00 | - | - |
| 国泰君安 | - | - | -            | -      | - | - |

### 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  | 关于旗下部分开放式基金新增博时财富为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠业务的公告         | 《证券时报》、规定网站 | 2023年1月12日  |
| 2  | 关于旗下部分开放式基金新增博时财富为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其费率优惠业务的公告         | 《证券时报》、规定网站 | 2023年1月16日  |
| 3  | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金 2022 年 4 季度报告                          | 《证券时报》、规定网站 | 2023年1月19日  |
| 4  | 关于旗下部分开放式基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2023年3月9日   |
| 5  | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告                             | 《证券时报》、规定网站 | 2023年3月30日  |
| 6  | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金 2023 年 1 季度报告                          | 《证券时报》、规定网站 | 2023年4月21日  |
| 7  | 关于旗下部分开放式基金新增万家财富基金销售(天津)有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2023年7月24日  |
| 8  | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金 2023 年第二季度报告                           | 《证券时报》、规定网站 | 2023年7月20日  |
| 9  | 泰信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和托管费率并修订基金合同等事项的公告                | 《证券时报》、规定网站 | 2023年8月12日  |
| 10 | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金招募说明书更新(2023年1号)、产品资料概要更新、基金合同、托管协议     | 《证券时报》、规定网站 | 2023年8月12日  |
| 11 | 泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                      | 《证券时报》、规定网站 | 2023年8月23日  |
| 12 | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金 2023 年中期报告                             | 《证券时报》、规定网站 | 2023年8月30日  |
| 13 | 关于旗下部分开放式基金新增平安证券股份有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动          | 《证券时报》、规定网站 | 2023年10月11日 |

|    |   |             |                  |
|----|---|-------------|------------------|
|    | 的公告   |             |                  |
| 14 | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金 2023 年第三季度报告                             | 《证券时报》、规定网站 | 2023 年 10 月 24 日 |
| 15 | 泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金招募说明书更新（2023 年 2 号）、产品资料概要                | 《证券时报》、规定网站 | 2023 年 11 月 2 日  |
| 16 | 关于旗下部分开放式基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务并参加其费率优惠活动的公告     | 《证券时报》、规定网站 | 2023 年 11 月 16 日 |
| 17 | 关于旗下部分开放式基金新增深圳众禄基金销售股份有限公司为销售机构并开通转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、规定网站 | 2023 年 11 月 21 日 |
| 18 | 关于旗下部分基金新增上海中欧财富基金销售有限公司为销售机构并开通转换、定投业务及参加其费率优惠活动的公告        | 《证券时报》、规定网站 | 2023 年 12 月 20 日 |
| 19 | 泰信基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所股票及相关风险提示的公告                           | 《证券时报》、规定网站 | 2023 年 12 月 30 日 |

## § 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

| 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   | 1              | 20230101 - 20231231     | 10,002,888.88 | 0.00 | 0.00 | 10,002,888.88 | 25.14    |
| 产品特有风险   |                |                         |               |      |      |               |          |
| <p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p> |                |                         |               |      |      |               |          |

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，泰信基金管理有限公司决定自 2023 年 8 月 14 日起，调低本基金的管理费率和/或托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详情请参见 2023 年 8 月 12 日发

布《泰信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率 and/或托管费率并修订基金合同等事项的公告》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信低碳经济混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

### 13.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

### 13.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站([www.ftfund.com](http://www.ftfund.com))查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988, 021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2024年3月28日