

中金华证清洁能源主题指数发起式证券投资
基金
2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 20 日

§1 重要提示

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

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 04 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中金华证清洁能源指数发起
基金主代码	016915
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 10 月 27 日
报告期末基金份额总额	16,182,134.51 份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。具体包括：1、组合复制策略；2、替代性策略；3、债券投资策略；4、可转债投资策略；5、可交债投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股指期货、国债期货及股票期权的投资策略；8、转融通投资策略；9、融资投资策略；10、存托凭证投资策略。详见《中金华证清洁能源主题指数发起式证券投资基金基金合同》。

业绩比较基准	华证清洁能源主题指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	中金基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中金华证清洁能源指数发起 A	中金华证清洁能源指数发起 C
下属分级基金的交易代码	016915	016916
报告期末下属分级基金的份额总额	6,226,307.87 份	9,955,826.64 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）	
	中金华证清洁能源指数发起 A	中金华证清洁能源指数发起 C
1. 本期已实现收益	-283,886.51	-438,261.67
2. 本期利润	-191,484.71	-389,089.82
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0315	-0.0408
4. 期末基金资产净值	3,291,136.02	5,243,768.96
5. 期末基金份额净值	0.5286	0.5267

注：1. 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；

2. 本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金华证清洁能源指数发起 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.40%	2.06%	-5.10%	2.06%	-0.30%	0.00%
过去六个月	-16.08%	1.89%	-15.59%	1.89%	-0.49%	0.00%

过去一年	-37.39%	1.74%	-37.58%	1.74%	0.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	-47.14%	1.68%	-46.16%	1.74%	-0.98%	-0.06%

中金华证清洁能源指数发起 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.47%	2.06%	-5.10%	2.06%	-0.37%	0.00%
过去六个月	-16.20%	1.89%	-15.59%	1.89%	-0.61%	0.00%
过去一年	-37.55%	1.74%	-37.58%	1.74%	0.03%	0.00%
自基金合同生效起至今	-47.33%	1.68%	-46.16%	1.74%	-1.17%	-0.06%

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

中金华证清洁能源指数发起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



中金华证清洁能源指数发起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对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 10 月 27 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘重晋	本基金基金经理	2022 年 10 月 27 日	-	12 年	刘重晋先生，理学博士。历任松河投资咨询（深圳）有限公司副总经理、量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化指数部基金经理。

注：上述基金经理任职日期为本基金基金合同生效日。

4.1.1 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

本报告期，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

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守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金采用完全复制华证清洁能源主题指数的策略，按照标的指数的成份股构成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金按照基金合同约定保持较高仓位运作，力争使组合与基准收益率的跟踪偏离和跟踪误差保持在较低水平。

2024 年一季度，A 股市场探底回升，主要指数呈现 V 型走势。春节前市场结构性调整特征明显，过去三年相对强势的小微市值风格连续回调，使得 A 股市场持仓结构实现较为完整的出清过程。伴随市场支持举措不断落地，春节后主要指数自估值历史低位出现一轮修复性反弹行情，大市值规模指数年初以来已录得正收益。一季度，市场代表性指数中，沪深 300 指数表现上涨 3.10%，中证 500 指数下跌 2.64%，中证 1000 指数下跌 7.58%。风格方面，大盘表现优于小盘，价值继续战胜成长。行业方面，石油石化、家电、银行、煤炭、有色等表现居前，综合、医药、电子、房地产、计算机等表现靠后。

展望未来，我们认为投资者持仓结构对市场走势的影响边际下降，宏观基本面重新成为市场关注的核心变量。国内方面，中国经济复苏的广度和深度正逐步深化，工业、服务业、消费等领域均出现不同程度改善。后续在宏观政策协同发力下，需求潜力或将进一步释放，这有助于推动经济总量实现高质量增长，也有利于物价水平平稳回升，从而降低风险资产的溢价水平。海外方面，伴随部分就业数据的发布，市场对美联储货币政策的节奏再次产生较大的分歧，但全球大部分央行的加息周期已经基本结束，市场对美联储货币政策的分歧也更多是减息节奏和幅度而非政策方向，因此，国内资产价格修复仍然有机会迎来比去年更好的流动性环境。考虑到 A 股市场整

体仍处于估值历史低位区间，且市场持仓结构已实现完整出清，我们认为 A 股市场未来一个阶段的机会将大于风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中金华证清洁能源指数发起 A 基金份额净值为 0.5286 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.40%；截至本报告期末中金华证清洁能源指数发起 C 基金份额净值为 0.5267 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.47%；同期业绩比较基准收益率为-5.10%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，截止本报告期末，本基金成立未满三年。《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于基金份额持有人数量及基金资产净值的限制性条款暂不适用于本基金。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	8,109,495.96	90.13
	其中：股票	8,109,495.96	90.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	607,724.00	6.75
	其中：债券	607,724.00	6.75
	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	194,307.70	2.16
8	其他资产	86,391.34	0.96
9	合计	8,997,919.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,415,250.96	86.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	694,245.00	8.13

E	建筑业		
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业		
J	金融业		
K	房地产业		
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	8,109,495.96	95.02

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	10,000	1,038,000.00	12.16
2	601012	隆基绿能	28,800	561,888.00	6.58
3	600905	三峡能源	110,100	516,369.00	6.05
4	688223	晶科能源	61,000	505,080.00	5.92
5	601865	福莱特	14,700	418,803.00	4.91
6	300316	晶盛机电	12,100	414,667.00	4.86
7	600089	特变电工	26,050	399,086.00	4.68
8	688599	天合光能	16,000	380,800.00	4.46
9	600438	通威股份	11,300	281,031.00	3.29
10	603806	福斯特	9,780	277,849.80	3.26

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	607,724.00	7.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	607,724.00	7.12

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019685	22 国债 20	3,000	303,538.52	3.56
2	019709	23 国债 16	2,000	202,240.27	2.37
3	019703	23 国债 10	1,000	101,945.21	1.19

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末，本基金未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,087.53
2	应收证券清算款	80,462.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,841.45
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	86,391.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中金华证清洁能源指数发 起 A	中金华证清洁能源指数发 起 C
报告期期初基金份额总额	5,831,048.51	8,793,544.84
报告期期间基金总申购份额	1,140,674.89	8,433,562.56
减：报告期期间基金总赎回份额	745,415.53	7,271,280.76
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	6,226,307.87	9,955,826.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	中金华证清洁能源指数发 起 A	中金华证清洁能源指数发 起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,225.00	5,000,225.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,225.00	5,000,225.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总 份额比例（%）	80.31	50.22

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 报告期末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 自有资金	10,000,450.00	61.80	10,000,450.00	61.80	自基金合同生效 之日起不少于三 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	10,000,450.00	61.80	10,000,450.00	61.80	-

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 (%)
自有资金	1	2024 年 01 月 01 日 - 2024 年 03 月 31 日	10,000,450.00	-	-	10,000,450.00	61.80
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形。如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，从而可能面临基金合同终止等基金合同中约定的情形。</p>							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中金华证清洁能源主题指数发起式证券投资基金募集注册的文件
- 2、《中金华证清洁能源主题指数发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《中金华证清洁能源主题指数发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《中金华证清洁能源主题指数发起式证券投资基金招募说明书》及其更新
- 5、中金华证清洁能源主题指数发起式证券投资基金申请募集注册的法律意见书

- 6、基金管理人业务资格批复和营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复和营业执照
- 8、报告期内中金华证清洁能源主题指数发起式证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

10.3 查阅方式

投资者可在基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：（86）010-63211122 400-868-1166

传真：（86）010-66159121

中金基金管理有限公司

2024 年 4 月 20 日