

# 汇添富碳中和主题混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 10 月 25 日

## § 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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	汇添富碳中和主题混合
基金主代码	013147
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 09 月 14 日
报告期末基金份额总额(份)	3,893,538,605.80
投资目标	本基金在科学严格管理风险的前提下，重点投资于碳中和主题相关上市公司，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金。投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略主要用于挖掘股票市场中与碳中和主题相关的优质上市公司。本基

	金的投资策略包括：资产配置策略、个股精选策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资投资策略、国债期货投资策略、可转债及可交换债投资策略等。	
业绩比较基准	中证内地低碳经济主题指数收益率*70%+中债综合指数收益率*30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 本基金还可投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	汇添富碳中和主题混合 A	汇添富碳中和主题混合 C
下属分级基金的交易代码	013147	013148
报告期末下属分级基金的份额总额(份)	3,143,526,036.98	750,012,568.82

### § 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(2023年07月01日 - 2023年09月30日)	
	汇添富碳中和主题混合 A	汇添富碳中和主题混合 C
1. 本期已实现收益	-210,202,960.39	-50,699,363.20
2. 本期利润	-363,315,139.05	-85,579,781.39
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1135	-0.1133
4. 期末基金资产净值	1,727,179,002.18	407,062,853.19
5. 期末基金份额净值	0.5494	0.5427

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

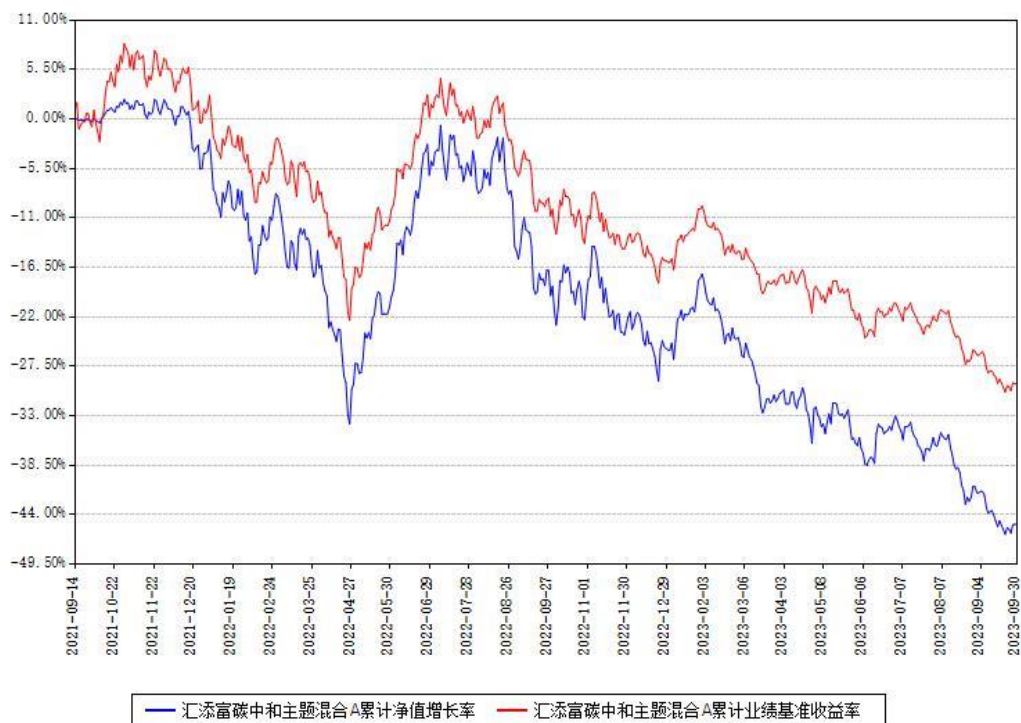
### 3.2 基金净值表现

#### 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

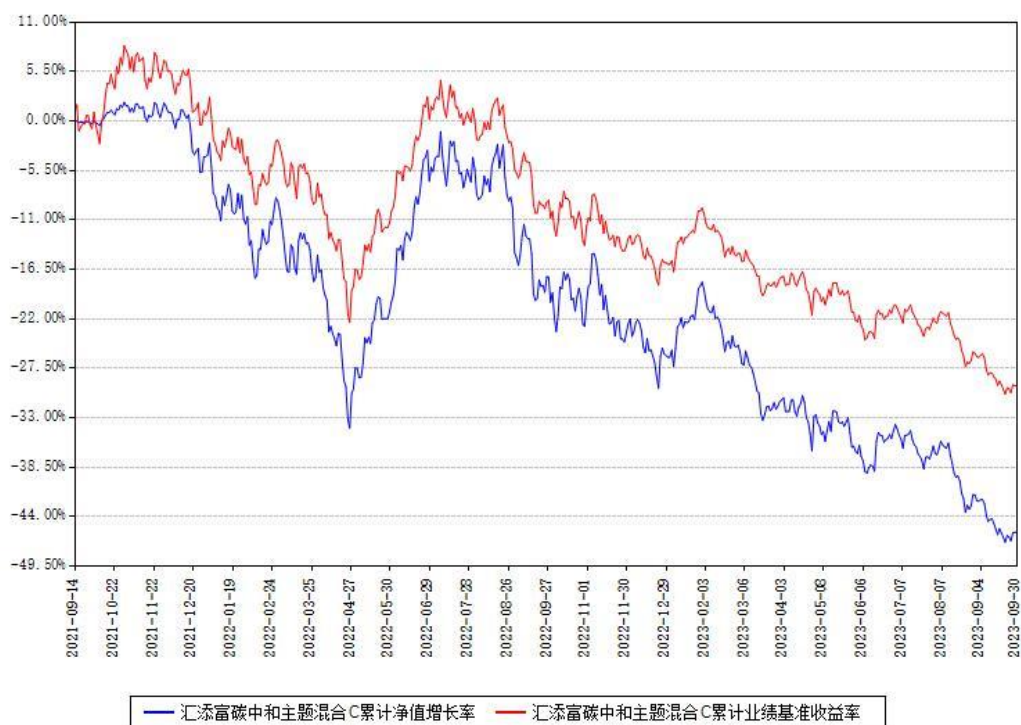
汇添富碳中和主题混合 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-17.12%	1.12%	-11.14%	0.74%	-5.98%	0.38%
过去六个月	-21.09%	1.42%	-14.63%	0.91%	-6.46%	0.51%
过去一年	-30.25%	1.53%	-20.00%	0.98%	-10.25%	0.55%
自基金合同生效日起至今	-45.06%	1.62%	-29.43%	1.19%	-15.63%	0.43%
汇添富碳中和主题混合 C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-17.25%	1.12%	-11.14%	0.74%	-6.11%	0.38%
过去六个月	-21.33%	1.42%	-14.63%	0.91%	-6.70%	0.51%
过去一年	-30.67%	1.53%	-20.00%	0.98%	-10.67%	0.55%
自基金合同生效日起至今	-45.73%	1.62%	-29.43%	1.19%	-16.30%	0.43%

### 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

汇添富碳中和主题混合A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富碳中和主题混合C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2021年09月14日）起6个月，建仓期结

束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
赵剑	本基金的 基金经理	2021 年 09 月 14 日	-	13	国籍：中 国。学历： 清华大学工 学硕士。从 业资格：证 券投资基金 从业资格。 从业经历： 2007 年至 2009 年任职 麦肯锡咨询 (上海) 有 限公司。 2009 年 9 月 加入汇添富 基金管理股 份有限公司，历任行 业分析师、 高级行业分 析师、投资 经理。2020 年 5 月 20 日 至今任汇添 富环保行业 股票型证券 投资基金的 基金经理。 2021 年 9 月 14 日至今任 汇添富碳中 和主题混合 型证券投资 基金的基金 经理。2022 年 2 月 25 日 至今任汇添

					富低碳投资一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月 14 日至今任汇添富进取成长混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式,确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下:

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程,以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则,对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块,实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析,具体方法为:在不同时间窗口(日内、3

日内、5 日内) 下, 对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易, 再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析, 进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易, 根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上, 本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估, 严格执行了公平交易制度, 公平对待了旗下各投资组合。本报告期内, 未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内, 本基金管理人管理的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超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 14 次, 投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控, 事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析, 未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度, 全球经济边际改善。美国 9 月 ISM 制造业指数上升至 49, 连续 3 个月反弹。虽然仍位于荣枯线以下, 但 ISM 制造业指数收缩幅度大幅收窄。2023 年 9 月的美联储议息会议暂停加息, 联邦基金利率目标区间维持在 5.25-5.50% 不变, 但是抬升了对通胀上行的担忧, 降低了对于经济风险的担忧, 未来可能还有 1-2 次加息。国内 9 月制造业 PMI 重返荣枯线以上, 实现连续 4 个月上升, 经济延续温和复苏。随着政策的加码, 预计经济将继续企稳向好。

在上述背景下, 三季度市场呈先涨后跌的震荡走势。整体看, 三季度上证指数下跌 2.86%, 深证成指下跌 8.32%, 沪深 300 下跌 3.98%, 创业板指下跌 9.53%。

三季度行业分化很大。中信一级行业指数中, 涨幅较大的行业包括煤炭、非银行金融、石油石化、银行, 分别上涨 10.37%、6.48%、5.79%、5.20%; 跌幅居前的行业包括传媒、计算机、电力设备与新能源、国防军工, 分别下跌 14.19%、13.88%、13.53%、9.32%。整体上, 上游能源资源、大金融等行业表现比较好, TMT、新能源等成长行业表现比较差。

本基金主要投资于“碳中和”政策受益的行业, 重点投资于新能源汽车、光伏、风电、储能、氢能等能源变革行业。三季度, 新能源汽车、光伏等行业需求仍保持较快增长, 但是由于过去两年产业链产能的大幅扩张, 竞争加剧, 产品价格压力较大。因此, 三季度板块整体表现一般。



本基金三季度主要增持了汽车智能化、光伏新技术等资产。

另外，本基金注重将 ESG 投资理念纳入投资实践过程中。我们的目标是在信守契约，为投资者增添财富的同时，将对公司内外、社会各方面的责任统一融入公司使命和企业文化中，依托金融行业的优势，积极打造社会责任品牌，促进自身和利益相关方共同可持续发展。

我们理解联合国可持续发展目标（Sustainable Development Goals, SDGs）是一项全球性事业，旨在追求可持续的经济增长，同时解决包括教育、卫生、社会保障和就业机会在内的社会需求，并应对气候变化和其他环境问题。本基金旨在通过系统化评估方法精选出 ESG 特征突出且具有持续成长潜力的公司进行投资，对体面工作与经济增长、可持续城市和社区、负责任消费和生产等 SDGs 的支持最明显，对其他 SDGs 如产业、创新和基础设施、气候行动等也有积极响应。

本基金依托基金管理人投研团队自主建立的 ESG 评估数据库和评价体系，综合不同行业的特征，从环境、社会、公司治理三个维度对投资标的进行 ESG 定量和定性评价。环境方面的主要参考指标有环保目标及政策、环保负面事件、资源强度及效率、废物及排放水平等；社会方面的主要参考指标有员工发展及多样化、上下游供应链及客户利益、员工健康安全、社会贡献等；公司治理方面的主要参考指标有商业道德、董事及管理层、公司经营战略及措施、股东利益、信息披露透明度等。

我们定期对主要公司的 ESG 评分进行更新，并重点选择评分较高的公司进行投资。我们也积极采用正面筛选、负面筛选、ESG 整合策略等方法寻找机会和规避风险，三季度取得了一定的效果。

正面筛选主要采用“自下而上”的投资方法，基于自主建立的 ESG 评价体系对公司的财务和 ESG 指标进行综合考量，考量的维度包括气候变化、资源利用、环境管理、供应链管控、产品安全、社会责任、公司治理、董事会结构等，进而筛选出具有中长期可持续成长潜力的公司进行投资。负面筛选即排除不满足 ESG 要求的投资标的。我们按照具体条件对重点关注行业进行条件筛查，如符合相关情况则由研究员进行筛选评估，上报 ESG 执行工作小组审议，并交由 ESG 投资委员会审批筛选排除。ESG 整合策略是将环境、社会和公司治理等的风险和机会系统化地融入到传统的财务和估值分析过程中。我们综合考虑投资标的的财务、非财务、非结构化等信息，考虑不同行业的特征，重在运用 ESG 因素分析公司的盈利能力及战略前景，提升企业的财务分析能力，便于界定目标公司未来的市场竞争地位。

我们的风险管理部负责 ESG 投资风险管理，主要工作包括：实时监控各投资组合整体 ESG 评分情况，低于对标指数时及时给出风险提示；实时监控 ESG 舆情，提供给研究部、各

投资部门参考；积极考虑环境、气候、社会等各种因素对公司声誉、形象可能造成的风险，制定合适的计划来管理和规避这些风险。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富碳中和主题混合 A 类份额净值增长率为-17.12%，同期业绩比较基准收益率为-11.14%。本报告期汇添富碳中和主题混合 C 类份额净值增长率为-17.25%，同期业绩比较基准收益率为-11.14%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 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	1,858,593,992.81	86.84
	其中：股票	1,858,593,992.81	86.84
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	281,221,530.99	13.14
8	其他资产	501,734.19	0.02
9	合计	2,140,317,257.99	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 4,992,213.69 元，占期末净值比例为 0.23%。

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	94,866.20	0.00
C	制造业	1,635,088,124.83	76.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	128,808,295.85	6.04
E	建筑业	121,754.31	0.01
F	批发和零售业	507,905.09	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	47,510.17	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,322,326.41	1.14
J	金融业	197,013.67	0.01
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	1,137,712.54	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	62,989,929.17	2.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	181,843.40	0.01
R	文化、体育和娱乐业	104,497.48	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,853,601,779.12	86.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------

10 能源	-	-
15 原材料	4,720.29	0.00
20 工业	-	-
25 可选消费	4,987,493.40	0.23
30 日常消费	-	-
35 医疗保健	-	-
40 金融	-	-
45 信息技术	-	-
50 电信服务	-	-
55 公用事业	-	-
60 房地产	-	-
合计	4,992,213.69	0.23

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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	300750	宁德时代	960,134	194,936,006.02	9.13
2	300274	阳光电源	2,111,942	189,039,928.42	8.86
3	600900	长江电力	4,836,801	107,570,454.24	5.04
4	002594	比亚迪	366,400	86,726,880.00	4.06

5	601012	隆基绿能	3,118,546	85,073,934.88	3.99
6	688390	固德威电源	610,990	80,766,768.10	3.78
7	002709	天赐材料	2,839,284	76,745,846.52	3.60
8	300014	亿纬锂能	1,638,900	73,947,168.00	3.46
9	603568	伟明环保	3,507,337	62,079,864.90	2.91
10	601865	福莱特	1,961,904	55,561,121.28	2.60

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注: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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 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

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有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	49,469.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	452,264.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	501,734.19

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富碳中和主题混合 A	汇添富碳中和主题混合 C
本报告期初基金份额总额	3,236,094,252.95	751,650,209.27
本报告期基金总申购份额	32,826,242.12	87,567,974.26

减：本报告期基金总赎回份额	125,394,458.09	89,205,614.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,143,526,036.98	750,012,568.82

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

注：无

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富碳中和主题混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富碳中和主题混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富碳中和主题混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富碳中和主题混合型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com)

查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 10 月 25 日