

诺安低碳经济股票型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:诺安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 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	50
7.7 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	50
7.8 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	50
7.9 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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

8.3 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	52
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安低碳经济股票型证券投资基金	
基金简称	诺安低碳经济股票	
基金主代码	001208	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年05月12日	
基金管理人	诺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	302,435,270.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	诺安低碳经济股票A	诺安低碳经济股票C
下属分级基金的交易代码	001208	010349
报告期末下属分级基金的份额总额	302,267,846.79份	167,423.46份

注：自2020年10月28日起，本基金增加基金份额类别，分设A类基金份额和C类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于低碳经济主题相关上市公司，在控制投资风险的同时，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略方面，本基金将采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的资产配置策略，根据宏观经济运行态势、政策变化、市场环境的变化，在长期资产配置保持稳定的前提下，积极进行短期资产灵活配置，力图通过时机选择构建在承受一定风险前提下获取较高收益的资产组合。</p> <p>本基金实施大类资产配置策略过程中还将根据各类证券的风险收益特征的相对变化，动态优化投资组合，以规避或控制市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、低碳经济主题配置策略</p> <p>a) 低碳经济主题及其相关行业和公司的界定</p> <p>走向低碳化时代是大势所趋，低碳经济也势在必行。低碳经济是一项系统工程，必须从经济和社会整体出发，着重在七个方面实现。低碳经济主题相关行业和公司来自于这七个方面：能源低碳化</p>

如以新能源、节能减排、绿色发展等为主营业务，提供相关设备、技术、产品、服务等与能源产业链相关的行业或公司，交通低碳化如新能源汽车等行业或公司，建筑低碳化如生产使用节能环保建筑材料的相关行业或公司，农业低碳化如林业、有机农业等行业或公司，工业低碳化如发展节能减排积极参与碳排放交易与治理的工业行业或公司，服务低碳化如提倡智能信息化服务的行业或公司，消费低碳化如提倡绿色消费及可循环消费的酒店、旅游等行业或公司。

未来随着经济增长方式转变和产业结构升级，从事或受益于上述投资主题的外延将会逐渐扩大，本基金将视实际情况调整上述对低碳经济主题类股票的识别及认定。

b) 行业配置策略

本基金将分别从以下几个方面对低碳经济的各个子行业进行分析：

(1) 政策分析：本基金将密切关注低碳经济相关国家产业政策以及财政税收政策和货币政策等变化对低碳经济主题相关行业的影响，积极配置收益于政策变化的行业。

(2) 公司分析：技术水平将影响低碳经济主题相关公司的发展情况。本基金将密切跟踪低碳经济主题相关公司技术水平变化及发展趋势，重点关注技术水平提升较快且发展趋势良好的上市公司。

(3) 市场分析：低碳经济主题相关行业可能会处于各自不同的发展阶段及行业周期，本基金将重点关注处于行业上升阶段及上升周期的子行业进行投资。

3、个股投资策略方面，本基金将结合定量与定性分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力，选择具有领先优势、创新能力及成长潜力良好的上市公司进行投资。

4、债券投资策略方面，本基金的债券投资部分采用积极管理的投资策略，具体包括利率预测策略、收益率曲线预测策略、溢价分析策略以及个券估值策略。

5、权证投资策略方面，本基金将主要运用价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，我们将结合自身资产状况审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。

6、资产支持证券投资策略

本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过对资产

	<p>池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，谨慎投资资产支持证券。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>未来，根据市场情况，基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中证内地低碳经济主题指数与中证全债指数的混合指数，即： $80\% \times$ 中证内地低碳经济主题指数收益率 + $20\% \times$ 中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐斌	郭明
	联系电话	0755-83026688	(010) 66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	(010) 66105798
注册地址		深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址		深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		秦维舟	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管

	理有限公司
--	-------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	诺安低碳经济股票A	诺安低碳经济股票C
本期已实现收益	91,167,497.56	539,017.18
本期利润	59,101,557.02	324,680.05
加权平均基金份额本期利润	0.1963	0.1025
本期加权平均净值利润率	10.37%	5.35%
本期基金份额净值增长率	11.55%	11.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	290,353,071.05	161,522.60
期末可供分配基金份额利润	0.9606	0.9648
期末基金资产净值	592,620,917.84	328,946.06
期末基金份额净值	1.961	1.965
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	96.10%	10.95%

注：①上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益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期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

④自2020年10月28日起，本基金分设两级基金份额：A类基金份额和C类基金份额，详情请参阅相关公告。

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

诺安低碳经济股票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
过去一个月	-0.05%	0.50%	9.65%	1.56%	-9.70%	-1.06%
过去三个月	3.21%	0.57%	25.51%	1.45%	-22.30%	-0.88%
过去六个月	11.55%	0.80%	22.47%	1.83%	-10.92%	-1.03%
过去一年	42.20%	0.98%	70.73%	1.65%	-28.53%	-0.67%
过去三年	82.08%	1.11%	104.36%	1.37%	-22.28%	-0.26%
自基金合同生效起至今	96.10%	1.32%	51.81%	1.43%	44.29%	-0.11%

诺安低碳经济股票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
过去一个月	-0.10%	0.50%	9.65%	1.56%	-9.75%	-1.06%
过去三个月	3.58%	0.56%	25.51%	1.45%	-21.93%	-0.89%
过去六个月	11.71%	0.80%	22.47%	1.83%	-10.76%	-1.03%
自基金合同生效起至今	10.95%	0.79%	42.73%	1.76%	-31.78%	-0.97%

注：①本基金的业绩比较基准为：80%×中证内地低碳经济主题指数收益率+20%×中证全债指数收益率。

②自2020年10月28日起，本基金分设为两类基金份额：A类基金份额和C类基金份额；其中C类份额自2020年11月17日开始有申购数据，C类基金份额的指标计算自申购数据确认日（2020年11月18日）算起。

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

诺安低碳经济股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年05月12日-2021年06月30日)



诺安低碳经济股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年11月17日-2021年06月30日)



注：①本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定；
②本基金 C 类份额从 2020 年 11 月 17 日开始有申购数据。

§ 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

截至2021年6月30日，本基金管理人共管理62只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深300指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证500指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安恒惠债券型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金等。

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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
蔡宇滨	本基金基金经理	2019年01月22日	-	12年	硕士，具有基金从业资格。曾先后任职于IMI亚太总部、招商证券，2014年3月加入诺安基金管理有限公司，历任研究员、投资经理。2017年12月至2021年3月任诺安平衡证券投资基金基金经理。2018年6月起任诺安策略精选股票型证券投资基金基金经理，2019年1月起任诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理。

注：①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日；

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，诺安低碳经济股票型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易

系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配；对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内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不存在超过该证券当日成交量的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

2021年二季度，国内货币政策保持稳定，流动性总体宽裕，十年期国债利率在一季度短暂突破3.5%后掉头向下最低突破3.1%。在流动宽松以及基本面向好的刺激下，成长风格股票大幅反弹，并创出新高。创业板指二季度涨了26.05%，而科创50涨了27.23%。另一方面，大盘价值股相对滞涨，部分行业如地产、家电、非银更是创出年内新低，成长股和价值股估值差距在一季度短暂收敛后重新扩大。

与之对应的，美国PPI和CPI一路往上，美联储预期明年提前紧缩，在各州逐渐停发补贴后，预计美国就业将会强劲复苏。受该预期影响，美债长端利率上升，中美利差收窄，美元指数在跌破90之后出现反弹，现反弹至92附近。因此二季度行情中，对美债利率敏感的外资偏好的长周期稳定增长的龙头企业表现欠佳，而对中债利率敏感的高成长赛道股大幅上涨。

本基金总体保持长期稳定的策略，持有较有竞争力、ROE较高、估值较低、现金流和分红比较客观的公司，并根据市场变化，加入部分成长性较高，估值合理的中盘蓝筹和中小市值公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，诺安低碳经济股票A基金份额净值为1.961元；本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.55%，同期业绩比较基准收益率为22.47%。

截至报告期末，诺安低碳经济股票C基金份额净值为1.965元；本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.71%，同期业绩比较基准收益率为22.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对三季度经济总体存在以下两个判断：

(1) 2021年全球PPI和CPI总体往上，流动性保持稳定但并不会过于宽松（相对2020年收紧），因此短期流动性宽松带来的债券利率下降或不可持续，下半年利率有重回3.5%的可能，给高估值成长股带来一定压力。

(2) 全球经济在疫情后逐步重建，但下半年海外经济表现或优于国内。由于我国采取有力措施控制疫情，经济在全年3季度全面企稳复苏，下半年面临高基数影响增长放缓。而海外受疫情打击，生产恢复缓慢，下半年随着疫情影响减小，生产和服务消费恢复，经济增长或保持较高增速。

因此，我们预期三季度行情总体表现或比较一般，以震荡调整为主，高估值和低估值板块估值重归收敛。一方面，流动性重新收紧或对高估值板块形成压力，另一方面，三季度高基数效应显现，上半年业绩高增速将不可持续。

即便如此，中国企业的生产效率和科研研发实力在全球竞争中优势依然明显，地位不断提升，各行业的龙头公司议价能力和抗风险能力大大提高。另一方面，部分传统行业龙头估值回到了历史极值底部，一旦基本面有所改善股价也会随之表现。因此，市场仍会存在大量结构性的机会和行情，在调整之后又是比较合适的布局机会。

在2019-2020年连续两年A股高收益之后，2021年将会是慢牛行情中调整蓄势的一年，投资者将需要调整收益预期，保持耐心，长期持有估值合理的优质资产。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由研究部、基金运营部、监察稽核部、风险控制部、权益投资事业部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组，负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

本报告期内, 本基金未进行利润分配, 符合合同约定。

4.8 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, 本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 本基金托管人在对诺安低碳经济股票型证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内, 诺安低碳经济股票型证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安低碳经济股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安低碳经济股票型证券投资基金2021年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 诺安低碳经济股票型证券投资基金

报告截止日: 2021年06月30日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	37,359,129.82	35,556,505.34
结算备付金		8,892,545.28	5,997,940.73
存出保证金		162,156.73	126,113.11
交易性金融资产	6.4.7.2	481,778,931.87	437,887,738.95
其中: 股票投资		481,778,931.87	432,560,926.95

基金投资		-	-
债券投资		-	5,326,812.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	70,000,000.00	60,000,000.00
应收证券清算款		1,598,758.05	3,308,597.44
应收利息	6.4.7.5	6,797.59	-6,308.13
应收股利		-	-
应收申购款		631,712.05	510,656.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		600,430,031.39	543,381,243.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,952,432.51	-
应付赎回款		2,312,836.13	1,820,458.56
应付管理人报酬		732,728.21	686,263.67
应付托管费		122,121.36	114,377.29
应付销售服务费		146.52	17.70
应付交易费用	6.4.7.7	1,273,157.51	515,038.25
应交税费		-	21.18
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.8	86,745.25	50,917.71
负债合计		7,480,167.49	3,187,094.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	302,435,270.25	307,297,191.85
未分配利润	6.4.7.10	290,514,593.65	232,896,957.48
所有者权益合计		592,949,863.90	540,194,149.33
负债和所有者权益总计		600,430,031.39	543,381,243.69

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额总额302,435,270.25份，其中，诺安低碳经济股票A基金份额净值1.961元，基金份额总额302,267,846.79份；诺安低碳经济股票C基金份额净值1.965元，基金份额总额167,423.46份。

6.2 利润表

会计主体：诺安低碳经济股票型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
一、收入		68,543,404.58	32,462,004.84
1. 利息收入		667,842.22	529,887.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	139,143.54	219,911.62
债券利息收入		2,462.37	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		526,236.31	309,976.13
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		99,594,637.60	64,628,487.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	93,427,811.38	58,425,840.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	485,372.79	-

资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	5,681,453.43	6,202,646.51
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-32,280,277.67	-32,952,389.58
4. 汇兑收益（损失以“- ”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“- ”号填列）	6.4.7.18	561,202.43	256,019.58
减：二、费用		9,117,167.51	8,287,128.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,275,044.07	4,039,467.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	712,507.33	673,244.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,493.34	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,030,570.31	3,489,641.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		8.90	-
7. 其他费用	6.4.7.20	84,543.56	84,775.36
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		59,426,237.07	24,174,875.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“- ”号填列）		59,426,237.07	24,174,875.91

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：诺安低碳经济股票型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	307,297,191.85	232,896,957.48	540,194,149.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	59,426,237.07	59,426,237.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-4,861,921.60	-1,808,600.90	-6,670,522.50
其中：1. 基金申购款	116,327,599.97	105,014,859.95	221,342,459.92
2. 基金赎回款	-121,189,521.57	-106,823,460.85	-228,012,982.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	302,435,270.25	290,514,593.65	592,949,863.90
项 目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	512,214,009.87	159,445,427.58	671,659,437.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,174,875.91	24,174,875.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-156,273,085.47	-48,827,244.84	-205,100,330.31

其中：1. 基金申购款	59,398,447.66	17,375,843.36	76,774,291.02
2. 基金赎回款	-215,671,533.13	-66,203,088.20	-281,874,621.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	355,940,924.40	134,793,058.65	490,733,983.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

齐斌

田冲

薛有为

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安低碳经济股票型证券投资基金（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”）《关于准予诺安低碳经济股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕475号）批准，由诺安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2015年5月12日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为3,785,949,626.11份基金份额，其中认购资金利息折合1,083,452.93份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金于2020年10月28日起进行基金份额分级，分级后本基金设两级基金份额：A级基金份额和C级基金份额。A级基金份额的基金代码为001208（与分级前基金代码相同），基金简称“诺安低碳经济股票A”；C级基金份额代码为010349，基金简称“诺安低碳经济股票C”。两级基金份额适用相同的管理费率、托管费率。本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，但不从该类别基金资产中计提销售服务费；C类基金份额在申购时不收取申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》和《诺安低碳经济股票型证券投资基金招募说明书》的有关

规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行并上市的股票)、权证、股指期货等权益类投资工具，国债、金融债、公司债、企业债、可转换债券(含分离交易可转债)、央票、中期票据、资产支持证券等固定收益类品种，短期融资券、正回购、逆回购、定期存款、协议存款等货币市场工具，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。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产净值的比例不低于基金资产的80%，其中投资于低碳经济主题相关股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%；权证占基金资产净值的比例不超过3%；扣除股指期货合约缴纳的保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况、2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2012〕85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化

个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税

〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字〔2008〕16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自

解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
活期存款	37,359,129.82	
定期存款	-	
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	-	
合计	37,359,129.82	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	490,373,407.45	481,778,931.87	-8,594,475.58
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	490,373,407.45	481,778,931.87	-8,594,475.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	70,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	70,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	3,130.45
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,601.44
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	65.70

合计	6,797.59
----	----------

注：此处其他列示的是存出保证金利息收入。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	1,273,157.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,273,157.51

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付赎回费	2,442.69
预提费用	84,302.56
合计	86,745.25

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 诺安低碳经济股票A

金额单位：人民币元

项目 (诺安低碳经济股票A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	307,257,466.63	307,257,466.63
本期申购	104,202,669.89	104,202,669.89
本期赎回(以“-”号填列)	-109,192,289.73	-109,192,289.73
本期末	302,267,846.79	302,267,846.79

6.4.7.9.2 诺安低碳经济股票C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(诺安低碳经济股票C)	2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	39,725.22	39,725.22
本期申购	12,124,930.08	12,124,930.08
本期赎回(以“-”号填列)	-11,997,231.84	-11,997,231.84
本期末	167,423.46	167,423.46

注：本期申购转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 诺安低碳经济股票A

单位：人民币元

项目 (诺安低碳经济股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	236,467,813.70	-3,600,991.66	232,866,822.04
本期利润	91,167,497.56	-32,065,940.54	59,101,557.02
本期基金份额交易产生的变动数	-2,015,365.72	400,057.71	-1,615,308.01
其中：基金申购款	98,409,337.54	-4,458,519.44	93,950,818.10
基金赎回款	-100,424,703.26	4,858,577.15	-95,566,126.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	325,619,945.54	-35,266,874.49	290,353,071.05

6.4.7.10.2 诺安低碳经济股票C

单位：人民币元

项目 (诺安低碳经济股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,603.03	-467.59	30,135.44
本期利润	539,017.18	-214,337.13	324,680.05
本期基金份额交易产生的变动数	-388,478.61	195,185.72	-193,292.89
其中：基金申购款	11,605,144.91	-541,103.06	11,064,041.85
基金赎回款	-11,993,623.52	736,288.78	-11,257,334.74
本期已分配利润	-	-	-

本期末	181,141.60	-19,619.00	161,522.60
-----	------------	------------	------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
活期存款利息收入	84,612.12	
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	52,489.88	
其他	2,041.54	
合计	139,143.54	

注：此处其他列示的是申购款利息收入及存出保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
卖出股票成交总额	1,370,788,131.71	
减：卖出股票成本总额	1,277,360,320.33	
买卖股票差价收入	93,427,811.38	

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,800,135.10	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,309,595.41	
减：应收利息总额	5,166.90	
买卖债券差价收入	485,372.79	

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,681,453.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,681,453.43

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-32,280,277.67
——股票投资	-31,693,465.67
——债券投资	-586,812.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-32,280,277.67

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	505,942.80
转换费收入	55,259.63

合计	561, 202. 43
----	--------------

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	4, 030, 570. 31
银行间市场交易费用	-
合计	4, 030, 570. 31

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24, 795. 19
信息披露费	59, 507. 37
汇划手续费	241. 00
合计	84, 543. 56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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内不存在应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,275,044.07	4,039,467.53
其中：支付销售机构的客户维护费	1,588,302.53	1,751,702.80

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提，管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	712,507.33	673,244.52

注：本基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提，托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 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 2021年01月01日至2021年06月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安低碳经济股票A	诺安低碳经济股票C	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	0.00	195.50	195.50
中国工商银行股份有限公司(托管人)	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	195.50	195.50
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安低碳经济股票A	诺安低碳经济股票C	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	0.00	0.00	0.00
中国工商银行股份有限公司(托管人)	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.50%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 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内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 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无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月3 0日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	37,359,129.82	84,612.12	27,706,186.34	179,813.39

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.7 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内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 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内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
601872	招商轮船	2020-01-10	2022-01-10	非公开发行流通受限	4.47	4.33	1,119,403	5,000,000.96	4,847,014.99	-
688083	中望软件	2021-03-04	2021-09-13	新股锁定	150.50	524.08	1,198	180,299.00	627,847.84	-
688059	华锐	2021-	2021-	新股锁	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-

	精密	02-01	08-09	定						
688315	诺禾致源	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	12.76	39.20	3,711	47,352.36	145,471.20	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股锁定	33.22	87.50	777	25,811.94	67,987.50	-
688355	明志科技	2021-04-30	2021-11-12	新股锁定	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	新股锁定	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-
688685	迈信林	2021-04-30	2021-11-15	新股锁定	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-

300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭	2021-	2021-	新股锁	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

	科技	04-15	10-26	定						
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300971	博亚精工	2021-04-07	2021-10-15	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

本基金持有的流通受限股票“300948冠中生态”于受限期间实施转增股本方案，以资本公积向全体股东每10股转增5股，其数量与金额已包含在上述披露的数据中。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2021年6月30日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2021年6月30日，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2021年6月30日，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2021年6月30日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人为最大限度地实现公司风险管理的目标，以各机构及职能部门为依托，自上而下，建立了包括公司治理结构层、公司经营管理层、职能机构层、具体操作层在内的四级风险管理组织架构。

在公司治理结构层面，由董事会及其下设的合规审查与风险控制委员会进行宏观领导；在公司经营管理层面，由督察长领导下的合规风控委员会进行中观管理；在合规风控职能机构层面，公司设立独立的监察稽核部和风险控制部作为合规风控管理的职能部门；在具体操作层面，公司各业务部门及分支机构，负责具体合规风控管理职责的执行和操作。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在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。

于2021年6月30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（2020年12月31日：0.99%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险控制部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。首先，本基金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、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	6个月以内	6个月-	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	-------	------	------	------	-----	----

2021年06月30日		1年				
资产						
银行存款	37,359,129.82	-	-	-	-	37,359,129.82
结算备付金	8,892,545.28	-	-	-	-	8,892,545.28
存出保证金	162,156.73	-	-	-	-	162,156.73
交易性金融资产	-	-	-	-	481,778,931.87	481,778,931.87
买入返售金融资产	70,000,000.00	-	-	-	-	70,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	1,598,758.05	1,598,758.05
应收利息	-	-	-	-	6,797.59	6,797.59
应收申购款	30.00	-	-	-	631,682.05	631,712.05
资产总计	116,413,861.83	-	-	-	484,016,169.56	600,430,031.39
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,952,432.51	2,952,432.51
应付赎回款	-	-	-	-	2,312,836.13	2,312,836.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	732,728.21	732,728.21
应付托管费	-	-	-	-	122,121.36	122,121.36
应付销售服务费	-	-	-	-	146.52	146.52
应付交易费用	-	-	-	-	1,273,157.51	1,273,157.51
其他负债	-	-	-	-	86,745.25	86,745.25
负债总计	-	-	-	-	7,480,167.49	7,480,167.49
利率敏感度缺口	116,413,861.83	-	-	-	476,536,002.07	592,949,863.90
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月- 1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	35,556,505.34	-	-	-	-	35,556,505.34
结算备付金	5,997,940.73	-	-	-	-	5,997,940.73
存出保证金	126,113.11	-	-	-	-	126,113.11
交易性金融资产	-	-	-	5,326,812.00	432,560,926.95	437,887,738.95
买入返售金融资产	60,000,000.00	-	-	-	-	60,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	3,308,597.44	3,308,597.44
应收利息	-	-	-	-	-6,308.13	-6,308.13
应收申购款	40.00	-	-	-	510,616.25	510,656.25
资产总计	101,680,599.18	-	-	5,326,812.00	436,373,832.51	543,381,243.69
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,820,458.56	1,820,458.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	686,263.67	686,263.67
应付托管费	-	-	-	-	114,377.29	114,377.29
应付销售服务费	-	-	-	-	17.70	17.70
应付交易费用	-	-	-	-	515,038.25	515,038.25
应交税费	-	-	-	-	21.18	21.18
其他负债	-	-	-	-	50,917.71	50,917.71
负债总计	-	-	-	-	3,187,094.36	3,187,094.36
利率敏感度缺口	101,680,599.18	-	-	5,326,812.00	433,186,738.15	540,194,149.33

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年6月30日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2020年12月31日：0.99%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020年12月31日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产 — 股票投资	481,778,931.87	81.25	432,560,926.95	80.08
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	481,778,931.87	81.25	432,560,926.95	80.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	业绩比较基准发生变化	
	其他市场变量保持不变	
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影响金额（单

		位：人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	4,857,863.99	10,992,549.23
	业绩比较基准下降5%	-4,857,863.99	-10,992,549.23

注：本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$ 中证内地低碳经济主题指数收益率 $+20\% \times$ 中证全债指数收益率。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

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

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 469,677,957.88元，属于第二层次的余额为12,100,973.99元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为423,996,895.19元，属于第二层次的余额为13,890,843.76元，无属于第三层次的余额)。

(a) 第二层次的公允价值计量

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

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2020年12月31日：无)。

(2) 其他金融工具的公允价值(期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	481,778,931.87	80.24
	其中：股票	481,778,931.87	80.24
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	70,000,000.00	11.66
	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	46,251,675.10	7.70
8	其他各项资产	2,399,424.42	0.40
9	合计	600,430,031.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	1,682,316.00	0.28
C	制造业	204,021,299.65	34.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,044,179.60	1.36
E	建筑业	87,575,987.41	14.77
F	批发和零售业	6,083,760.28	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	11,487,154.01	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,352,092.86	2.42
J	金融业	49,881,819.38	8.41
K	房地产业	74,677,904.23	12.59
L	租赁和商务服务业	7,714,563.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	145,471.20	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	10,116,879.37	1.71
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	5,984,214.60	1.01
S	综合	-	-
	合计	481,778,931.87	81.25

7.3 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	000002	万科A	2,442,883	58,165,044.23	9.81
2	601117	中国化学	3,749,100	32,842,116.00	5.54
3	002081	金螳螂	3,303,612	26,164,607.04	4.41
4	601601	中国太保	820,600	23,772,782.00	4.01
5	002422	科伦药业	1,143,800	22,818,810.00	3.85
6	601668	中国建筑	4,414,500	20,527,425.00	3.46
7	601318	中国平安	266,826	17,151,575.28	2.89
8	600048	保利地产	1,371,500	16,512,860.00	2.78
9	688093	世华科技	302,926	12,044,337.76	2.03
10	601233	桐昆股份	472,400	11,380,116.00	1.92
11	603738	泰晶科技	276,300	9,537,876.00	1.61
12	002258	利尔化学	367,969	9,493,600.20	1.60
13	603639	海利尔	498,196	8,962,546.04	1.51
14	002236	大华股份	410,100	8,653,110.00	1.46

15	600516	方大炭素	1,119,280	8,327,443.20	1.40
16	300986	志特新材	194,964	7,848,639.48	1.32
17	601058	赛轮轮胎	773,440	7,726,665.60	1.30
18	300280	紫天科技	211,300	7,714,563.00	1.30
19	000063	中兴通讯	213,200	7,084,636.00	1.19
20	002930	宏川智慧	405,602	6,639,704.74	1.12
21	600409	三友化工	637,900	6,449,169.00	1.09
22	688089	嘉必优	135,925	6,238,957.50	1.05
23	002724	海洋王	457,620	6,228,208.20	1.05
24	603588	高能环境	419,323	6,071,797.04	1.02
25	002221	东华能源	546,866	5,988,182.70	1.01
26	600919	江苏银行	843,030	5,985,513.00	1.01
27	601900	南方传媒	767,207	5,984,214.60	1.01
28	601390	中国中铁	1,141,200	5,979,888.00	1.01
29	688109	品茗股份	76,799	5,962,674.36	1.01
30	605338	巴比食品	180,041	5,820,725.53	0.98
31	300121	阳谷华泰	459,500	5,656,445.00	0.95
32	600745	闻泰科技	56,000	5,426,400.00	0.92
33	688636	智明达	49,727	5,285,980.10	0.89
34	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.87
35	601872	招商轮船	1,119,497	4,847,449.27	0.82
36	600323	瀚蓝环境	183,600	4,000,644.00	0.67
37	002001	新和成	136,400	3,911,952.00	0.66
38	002415	海康威视	57,700	3,721,650.00	0.63
39	603181	皇马科技	195,573	3,377,545.71	0.57
40	688667	菱电电控	29,655	3,262,346.55	0.55
41	002223	鱼跃医疗	80,400	3,065,652.00	0.52
42	300674	宇信科技	160,340	2,996,754.60	0.51
43	002918	蒙娜丽莎	94,600	2,969,494.00	0.50
44	000100	TCL科技	385,400	2,948,310.00	0.50
45	603323	苏农银行	670,600	2,937,228.00	0.50

46	002957	科瑞技术	113,800	2,897,348.00	0.49
47	000997	新大陆	170,804	2,833,638.36	0.48
48	688033	天宜上佳	138,795	2,205,452.55	0.37
49	300982	苏文电能	36,717	2,050,936.93	0.35
50	688068	热景生物	10,042	1,897,938.00	0.32
51	002643	万润股份	105,000	1,866,900.00	0.31
52	600570	恒生电子	20,000	1,865,000.00	0.31
53	603228	景旺电子	71,000	1,860,200.00	0.31
54	000547	航天发展	93,700	1,768,119.00	0.30
55	600461	洪城环境	238,000	1,727,880.00	0.29
56	000951	中国重汽	62,400	1,688,544.00	0.28
57	600256	广汇能源	505,200	1,682,316.00	0.28
58	605089	味知香	15,200	1,322,704.00	0.22
59	300791	仙乐健康	22,740	1,259,796.00	0.21
60	603416	信捷电气	18,600	1,180,542.00	0.20
61	600025	华能水电	199,700	1,156,263.00	0.20
62	002960	青鸟消防	43,400	1,135,344.00	0.19
63	688083	中望软件	1,198	627,847.84	0.11
64	002597	金禾实业	17,100	593,370.00	0.10
65	603161	科华控股	41,900	593,304.00	0.10
66	603666	亿嘉和	6,500	592,540.00	0.10
67	600426	华鲁恒升	19,100	591,145.00	0.10
68	300837	浙矿股份	12,800	588,672.00	0.10
69	002332	仙琚制药	46,700	585,618.00	0.10
70	600161	天坛生物	17,000	582,250.00	0.10
71	603816	顾家家居	7,500	579,600.00	0.10
72	300587	天铁股份	25,500	572,475.00	0.10
73	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.03
74	688315	诺禾致源	3,711	145,471.20	0.02
75	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
76	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.02

77	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
78	688571	杭华股份	8,200	73,882.00	0.01
79	300979	华利集团	777	67,987.50	0.01
80	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
81	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.01
82	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
83	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.01
84	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
85	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
86	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.01
87	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
88	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
89	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
90	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
91	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
92	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
93	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
94	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
95	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
96	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
97	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
98	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
99	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
100	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
101	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
102	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
103	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
104	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
105	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
106	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
107	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00

108	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
109	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
110	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
111	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
112	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
113	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
114	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
115	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
116	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
117	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
118	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
119	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
120	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
121	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
122	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
123	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
124	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
125	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
126	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
127	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
128	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
129	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
130	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
131	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
132	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
133	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
134	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
135	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
136	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
137	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
138	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00

139	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
140	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
141	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
142	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
143	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
144	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
145	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
146	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601601	中国太保	35,665,481.88	6.60
2	000002	万科A	29,725,026.00	5.50
3	601117	中国化学	26,650,363.00	4.93
4	002081	金螳螂	25,383,761.07	4.70
5	601318	中国平安	22,072,233.99	4.09
6	688696	极米科技	21,855,420.31	4.05
7	600516	方大炭素	21,236,283.93	3.93
8	000651	格力电器	20,182,806.00	3.74
9	600297	广汇汽车	19,477,992.45	3.61
10	688608	恒玄科技	18,819,624.45	3.48
11	600919	江苏银行	18,147,839.70	3.36
12	601233	桐昆股份	17,416,811.60	3.22
13	002422	科伦药业	16,702,643.00	3.09
14	300280	紫天科技	16,295,669.60	3.02
15	300394	天孚通信	15,041,964.82	2.78
16	603639	海利尔	14,866,414.64	2.75
17	002724	海洋王	14,417,341.80	2.67
18	300253	卫宁健康	14,098,439.51	2.61

19	601058	赛轮轮胎	13,929,420.00	2.58
20	600048	保利地产	13,914,634.90	2.58
21	300121	阳谷华泰	12,986,858.00	2.40
22	600409	三友化工	12,660,963.00	2.34
23	601857	中国石油	12,564,866.45	2.33
24	002236	大华股份	12,542,294.00	2.32
25	300986	志特新材	12,010,888.29	2.22
26	601939	建设银行	11,474,001.00	2.12
27	600019	宝钢股份	11,210,575.33	2.08
28	688093	世华科技	11,158,155.00	2.07
29	000063	中兴通讯	11,004,544.00	2.04
30	688526	科前生物	10,856,688.21	2.01

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出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 累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	48,602,619.16	9.00
2	601166	兴业银行	38,041,067.20	7.04
3	601233	桐昆股份	35,911,159.57	6.65
4	688696	极米科技	29,513,775.16	5.46
5	601601	中国太保	26,395,183.00	4.89
6	688608	恒玄科技	21,442,819.04	3.97
7	600461	洪城环境	21,241,694.38	3.93
8	603444	吉比特	19,923,971.00	3.69
9	600297	广汇汽车	19,211,575.00	3.56
10	000651	格力电器	19,164,232.89	3.55
11	601939	建设银行	16,799,133.00	3.11
12	600919	江苏银行	16,332,664.40	3.02
13	600019	宝钢股份	15,788,759.00	2.92
14	300394	天孚通信	15,696,100.43	2.91

15	603156	养元饮品	15,585,608.82	2.89
16	300253	卫宁健康	14,858,397.90	2.75
17	601857	中国石油	13,887,003.00	2.57
18	600516	方大炭素	13,777,238.39	2.55
19	002111	威海广泰	12,907,980.00	2.39
20	002724	海洋王	12,621,934.90	2.34
21	600036	招商银行	12,404,180.00	2.30
22	601668	中国建筑	12,316,056.00	2.28
23	601088	中国神华	11,984,870.00	2.22
24	600188	兖州煤业	11,748,869.32	2.17
25	601058	赛轮轮胎	11,653,341.36	2.16
26	688526	科前生物	11,501,873.89	2.13
27	000002	万科 A	11,420,435.00	2.11
28	601006	大秦铁路	10,894,121.00	2.02

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	1,358,271,790.92
卖出股票收入（成交）总额	1,370,788,131.71

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 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投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体,除中国化学外,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中国化学工程股份有限公司(以下简称“中国化学”)因与关联方发生关联交易,未及时履行决策程序及信息披露义务,违反了《上海证券交易所股票上市规则》及《上海证券交易所上市公司关联交易指引》的规定,上交所上市公司监管一部于2020年7月20日对中国化学工程股份有限公司予以监管关注。

截至本报告期末,中国化学(601117)为本基金前十大重仓股。从投资角度看,未及时履行信息披露义务并未影响公司的长期竞争力,中国化学拥有全球领先的化学工程能力,业绩持续增长,具备长期投资价值 and 比较高的成长空间,因此本基金继续持有中国化学。本基金对该股票的投资符合法律法规和公司制度。

7.12.2 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。

7.12.3 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	162,156.73
2	应收证券清算款	1,598,758.05
3	应收股利	-
4	应收利息	6,797.59
5	应收申购款	631,712.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,399,424.42
---	----	--------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
诺安低碳经济股票A	20,870	14,483.37	100,546,578.35	33.26%	201,721,268.44	66.74%
诺安低碳经济股票C	48	3,487.99	0.00	0.00%	167,423.46	100.00%
合计	20,918	14,458.14	100,546,578.35	33.25%	201,888,691.90	66.75%

注：①分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

②户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 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	诺安低碳经济股票A	124,600.17	0.0412%
	诺安低碳经济股票C	56.47	0.0337%
	合计	124,656.64	0.0412%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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	诺安低碳经济股票A	0
	诺安低碳经济股票C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安低碳经济股票A	10~50
	诺安低碳经济股票C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安低碳经济股票A	诺安低碳经济股票C
基金合同生效日(2015年05月12日)基金份额总额	3,785,949,626.11	-
本报告期期初基金份额总额	307,257,466.63	39,725.22
本报告期基金总申购份额	104,202,669.89	12,124,930.08
减：本报告期基金总赎回份额	109,192,289.73	11,997,231.84
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	302,267,846.79	167,423.46

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会，没有基金份额持有人大会决议。

10.2 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

截至本报告披露日，本基金管理人重大人事变动情况如下：

李强先生担任公司董事长、于东升先生担任公司副总经理、总经理齐斌先生代任公司督察长；秦维舟先生不再担任公司董事长、马宏先生不再担任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人

高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人基金管理业务、本基金基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，公司收到深圳证监局关于子公司及相关人员的监管措施，公司按要求落实。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
华创证券	1	1,667,430,320.00	61.37%	1,552,871.86	64.93%	-
申万宏源	2	697,912,689.60	25.69%	636,011.47	26.59%	-
国盛证券	1	194,254,296.35	7.15%	138,173.38	5.78%	-
东方财富	1	157,255,833.34	5.79%	64,680.14	2.70%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期减少1家证券公司的1个交易单元：海通证券股份有限公司（1个交易单元）。

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务。
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。

10.7.2 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
华创证券	10,371,488.30	100.00%	5,736,000,000.00	100.00%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行开展的基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-04
2	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加申万宏源证券、申万宏源西部证券开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-01-04

		》、《证券日报》	
3	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-05
4	诺安基金管理有限公司关于终止泰信财富基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-16
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分增加汇成基金为代销机构并在汇成基金开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-01-18
6	诺安基金管理有限公司旗下基金2020年第4季度报告提示性公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-01-22
7	诺安低碳经济股票型证券投资基金2020年第4季度报告	基金管理人网站	2021-01-22
8	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国人寿为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-02-08
9	诺安基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021-02-08
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳新兰德为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-02-09

	的公告	》	
11	诺安基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统汇款交易业务基金申（认）购费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-03-12
12	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新浪仓石为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-03-16
13	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加同花顺为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-03-16
14	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金为代销机构并开通转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-03-16
15	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加蛋卷基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-03-16
16	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华财富为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-03-18
17	诺安基金管理有限公司关于深圳总部办公地址恢复办公及西部营销中心办公地址变更的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-03-29
18	诺安基金管理有限公司关于调整个人投资者在盈米基金的申购起点金额、最低赎回（转换、保有）份额的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-03-31

		》、《证券日报》	
19	诺安基金管理有限公司旗下基金2020年年度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-03-31
20	诺安低碳经济股票型证券投资基金2020年年度报告	基金管理人网站	2021-03-31
21	诺安基金管理有限公司关于终止成都万华源基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-04-01
22	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》	2021-04-06
23	诺安低碳经济股票型证券投资基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	《中国证券报》	2021-04-09
24	诺安低碳经济股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站	2021-04-09
25	诺安低碳经济股票型证券投资基金招募说明书（更新）2021年第1期	基金管理人网站	2021-04-09
26	诺安基金管理有限公司旗下基金2021年第1季度报告提示性公告	《证券时报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》	2021-04-22
27	诺安低碳经济股票型证券投资基金2021年第1季度报告	基金管理人网站	2021-04-22
28	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基	《中国证券报》	2021-04-23

	金增加国泰君安证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	、《证券日报》	
29	诺安基金管理有限公司关于增聘高级管理人员的公告	《中国证券报》	2021-04-28
30	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-05-07
31	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金为代销机构并开通定投业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-05-07
32	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加肯特瑞为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-05-14
33	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》	2021-05-29
34	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加蚂蚁基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-06-01
35	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加唐鼎耀华为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-06-01
36	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加天鼎证券为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-06-01
37	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加挖财基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》	2021-06-11

38	诺安基金管理有限公司关于终止部分代销机构代销本公司旗下基金的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-11
39	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为代销机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-18
40	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金开展的基金赎回费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-21
41	诺安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《上海证券报》	2021-06-26
42	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的基金申购及定投手续费率优惠的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-30
43	诺安基金管理有限公司关于旗下基金参加基煜基金开展的基金费率优惠活动的公告	《证券时报》、 《上海证券报》、 《中国证券报》、 《证券日报》	2021-06-30

注：前述所有公告事项均同时在基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站进行披露。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	期初份	申购	赎回份	持有份额	份额占比

		或者超过20%的时间区间	额	份额	额		
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金未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，敬请投资者留意							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人及本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安低碳经济股票型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安低碳经济股票型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安低碳经济股票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诺安低碳经济股票型证券投资基金2021年中期报告正文。
- ⑥报告期内诺安低碳经济股票型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日