

太平低碳经济混合型发起式证券投资基金清算报告

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

报告出具日期：二〇二六年八月二十五日

报告公告日期：二〇二六年九月二日

目录

1、重要提示..... 2

2、基金概况 3

3、基金运作情况说明 8

4、财务报告 9

5、清算事项说明 10

6、备查文件目录 13

1、重要提示

太平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[2023]667号予以注册，于2023年8月15日成立并正式运作。

根据《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》和《太平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》”或“基金合同”）的有关规定，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金的基金合同生效日为2023年8月15日，基金合同生效之日起三年后的对应日为2026年8月15日。截至2026年8月15日日终，本基金的基金资产净值低于两亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，基金管理人根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金最后运作日为2026年8月15日。本基金管理人自2026年8月16日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

本基金基金财产清算及基金合同终止安排详见2026年8月17日刊登在本基金管理人网站（www.taipingfund.com.cn）及中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn>）上的《关于太平低碳经济混合型发起式证券投资基金基金合同终止及财产清算的公告》。

本基金的最后运作日为2026年8月15日，并于2026年8月16日进入清算程序，由本基金管理人太平基金管理有限公司、基金托管人浙商银行股份有限公司、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和上海源泰律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、基金概况

2.1基金基本情况

基金名称	太平低碳经济混合型发起式证券投资基金	
基金简称	太平低碳经济混合发起式	
基金主代码	018327	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年8月15日	
基金管理人	太平基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
基金最后运作日（2026年8月15日）基金份额总额	14,147,612.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	太平低碳经济混合发起式A	太平低碳经济混合发起式C
下属分级基金的交易代码	018327	018328
基金最后运作日（2026年8月15日）下属分级基金份额总额	11,566,318.67份	2,581,293.76份

2.2基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金主要投资低碳经济相关行业证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可

	交换债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、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权等）以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例为60%-95%（其中港股通标的股票投资比例不得超过股票资产的50%），其中投资于本基金所界定的低碳经济主题相关行业股票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、国债期货合约和股票期权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、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	1、资产配置策略 本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。 2、股票投资策略

	(1) 低碳经济主题的界定 低碳经济是指在可持续发展理念指导下，通过技术创新、制度创新、产业转型、新能源开发等手段，尽可能地减少煤炭、石油等高碳能源消耗，减少温室气体排放，达到经济社会发展与生态环境保护“双赢”的一种经济发展模式。低碳经济以低能耗、低排放、低污染为特征，以应对碳基能源对气候变暖的影响为要求，以实现经济社会的可持续发展为目的。 本基金重点关注随着未来经济的发展、人口结构变化、环境与资源的制约以及国家政策目标和国际承诺的兑现带来的低碳经济主题相关的投资机会；以及其他各种有利于低碳经济发展的新产业、新技术、新商业模式带来的中长期的投资机会。 (2) 子行业配置策略 本基金投资标的将围绕低碳经济相关产业及行业，主要包括电力、交通、工业、新材料、建筑、农业以及负碳排放技术等领域。 1) 电力领域，包括光伏、风电、核电、水电、分布式发电、储能系统、特高压、智慧电网等； 2) 交通领域，包括新能源汽车产业链及其核心零部件（动力电池及材料、上游核心矿产资源、高端智能装备）； 3) 工业领域，包括在工业生产环节中，通过技术升级与工艺改造减少碳排放量，涉及钢铁、化工和机械设备行业。其中钢铁行业主要为受益于钢铁炼钢技术进步、促进碳减排的标的；化工行业主要为化工新材料和新技术，实现非化石能源对传统能源的替代的标的；机械设备行业主要关注两方面，一是新能源设备，主要满足下游新能源装机量需求，包括光伏设备、锂电设备、水电及风电设备、天然气设备及其核心零部件企业；二是新设备替代传统机械设备的转型，包括轨道交通设备、节油发动机和自动化设备； 4) 新材料领域，包括新型环保材料等；新型环保材料主要包
--	--

	含金属材料、无机非金属材料、生物医用材料、精细和专用化学品等； 5) 建筑领域，包括节能电气设备、清洁电力、地热能、隔热材料、建筑新材料等；其中，建筑新材料主要包含新型墙体材料、化学建材、新型保温隔热材料等； 6) 农业领域，包括林业等提供负碳的领域； 7) 负碳排放相关领域，包括碳监测、碳交易、碳金融、负碳技术等。 若未来由于政策变化或者技术创新所导致本基金低碳经济主题相关行业和公司相关业务的覆盖范围发生变动，基金管理人在履行适当程序后，有权适时对上述定义进行补充和修订。 (3) 个股选择策略 本基金在资产配置策略和行业优选策略的大框架下，精选优质个股构建组合，力争最大化个股收益。在具体行业里个股的选择过程中，本基金将建立公司价值股与成长股的备选股票池，综合考虑个股的核心竞争力、预期盈利增速、估值水平以及各个行业研究员的投资建议，选取高景气行业中的优质个股构建投资组合。 其余股票投资策略还包括股票组合的构建与调整、港股通标的股票的投资策略、存托凭证的投资策略。 3、债券投资策略 本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：（1）久期调整策略（2）收益率曲线配置策略（3）债券类属配置策略。 其他投资策略：资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略以及股票期权投资策略
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+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，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。 本基金如果投资港股通标的股票，需承担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。
--------	---

3、基金运作情况说明

本基金经中国证监会证监许可[2023]第667号《关于准予太平低碳经济混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由太平基金管理有限公司依照法律法规、基金合同等规定于2023年7月31日向社会公开发行募集，基金合同于2023年8月15日正式生效，募集规模为229,127,400.01份基金份额。

自2023年8月15日至2026年8月15日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《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》和《基金合同》的有关规定，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

本基金的基金合同生效日为2023年8月15日，基金合同生效之日起三年后的对应日为2026年8月15日。截至2026年8月15日日终，本基金的基金资产净值低于两亿元人民币，触发上述《基金合同》约定的终止情形，《基金合同》自动终止，基金管理人根据相关法律法规、基金合同等规定对本基金进行清算。本基金最后运作日为2026年8月15日。本基金管理人自2026年8月16日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

4、财务报告

4.1基金最后运作日资产负债表（已经审计）

会计主体：太平低碳经济混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026年8月15日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2026年8月15日
资产：	
货币资金	5,791,044.56
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	10,811,376.32
其中：股票投资	10,811,376.32
资产合计	16,602,420.88
负债和净资产	最后运作日 2026年8月15日
负债：	
应付清算款	—
应付赎回款	1,587.83
应付管理人报酬	8,418.52
应付托管费	1,403.08
应付销售服务费	840.36
其他负债	5,600.00
负债合计	17,849.79
净资产：	
实收基金	14,147,612.43
未分配利润	2,436,958.66
净资产合计	16,584,571.09
负债和净资产总计	16,602,420.88

注1：报告截止日2026年8月15日（基金最后运作日），太平低碳经济混合发起式A基金份额净值1.1761元，份额总额11,566,318.67份；太平低碳经济混合发起式C基金份额净值1.1550元，份额总额2,581,293.76份，总份额合计 14,147,612.43 份。

注2：本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平低碳经济混合型发起式证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于2026年8月15日（基金最后运作日），所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

5、清算事项说明

本基金的清算期间为自2026年8月16日至2026年8月25日止。基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.2资产处置情况

本基金最后运作日银行存款金额196,518.80元，其中包含应计活期存款利息为44.22元，前述利息将于2026年9月21日收回。

本基金最后运作日券商保证金资金金额5,594,525.76元，其中包含应计保证金利息为779.20元，前述利息已于2026年8月24日收回。

本基金最后运作日交易性金融资产估值金额人民币10,811,376.32元，其中股票投资为10,811,376.32元，已于2026年8月17日全部变现并划入券商资金户。

5.3负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币8,418.52元，已于2026年8月20日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币1,403.08元，已于2026年8月20日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币840.36元，已于2026年8月20日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币1,587.83元，已于2026年8月17日支付。
- (5) 本基金最后运作日其他负债为人民币5,600.00元，系应付清算审计费，已于2026年8月21日支付。

5.4清算期间的损益情况

单位：人民币元

项目	金额
----	----

一、最后运作日2026年8月15日基金净资产	16,584,571.09
加：清算期间（2026年8月16日至2026年8月25日）收入	1,463.67
1、存款利息收入	186.47
2、投资收益	488,178.36
3、公允价值变动损益	-486,901.16
减：清算期间（2026年8月16日至2026年8月25日）费用	10,000.00
1、其他费用	10,000.00
二、2026年8月25日（清算报告出具日）基金净资产	16,576,034.76

注1：存款利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2026年8月16日至2026年8月25日止银行存款、券商保证金的利息。

注2：投资收益系最后运作日未变现股票自2026年8月16日至2026年8月17日止处置取得的投资收益，包含处置过程中发生的交易费用、股票投资产生的股利收益与股息红利税。

注3：公允价值变动损益系最后运作日未变现股票自2026年8月16日至2026年8月17日止结转的公允价值变动损益。

注4：其他费用系应付清算律师费10,000.00元，已于2026年8月20日支付。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日2026年8月25日，本基金剩余财产为16,576,034.76元，根据本基金的《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例，并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日2026年8月26日至清算款项支付日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金利息归基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5.5基金资产清算的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时分配。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

6.1.1 太平低碳经济混合型发起式证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2 上海源泰律师事务所关于太平低碳经济混合型发起式证券投资基金清算事宜之法律意见

6.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼、5 楼 503A）

6.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平低碳经济混合型发起式证券投资基金基金财产清算小组

二〇二六年八月二十五日