

# 格林中短债债券型证券投资基金

2024年第2季度报告

2024年06月30日

基金管理人:格林基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19日

## 目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	8
4.5 报告期内基金的业绩表现	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	9
5.3 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	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	9
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	10
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	10
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	10
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	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	10
§6 开放式基金份额变动	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	12
8.1 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	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	12
§9 备查文件目录	12
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人中国兴业银行股份有限公司根据基金合同约定，于2024年7月18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4月1日起至2024年6月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	格林中短债
基金主代码	010145
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年10月28日
报告期末基金份额总额	2,670,497,683.22份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略包括久期配置策略、债券类属配置策略、信用债投资策略、息差策略、期限结构配置策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略。在债券类属配置策略上，本基金将根据对政府债券、信用债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，确定债券类属配置策略，并根据市场变化及时进行调整，从而选择既能匹配目标久期、同时又能获得较高持有期收益的类属债券配置比例。
业绩比较基准	中债综合财富（1-3年）指数收益率*90%+银行一年期定期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型、股票型基金。

基金管理人	格林基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	格林中短债A	格林中短债C
下属分级基金的交易代码	010145	010146
报告期末下属分级基金的份额总额	2,573,022,351.33份	97,475,331.89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04月01日 - 2024年06月30日)	
	格林中短债A	格林中短债C
1.本期已实现收益	15,764,457.50	469,169.06
2.本期利润	19,777,694.28	585,888.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0097	0.0085
4.期末基金资产净值	2,739,391,572.22	102,201,836.97
5.期末基金份额净值	1.0647	1.0485

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

格林中短债A净值表现

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	0.95%	0.03%	1.09%	0.03%	-0.14%	0.00%
过去六个月	1.95%	0.03%	2.13%	0.02%	-0.18%	0.01%
过去一年	3.55%	0.03%	3.54%	0.02%	0.01%	0.01%
过去三年	11.66%	0.03%	10.42%	0.03%	1.24%	0.00%
自基金合同	13.96%	0.04%	13.15%	0.03%	0.81%	0.01%

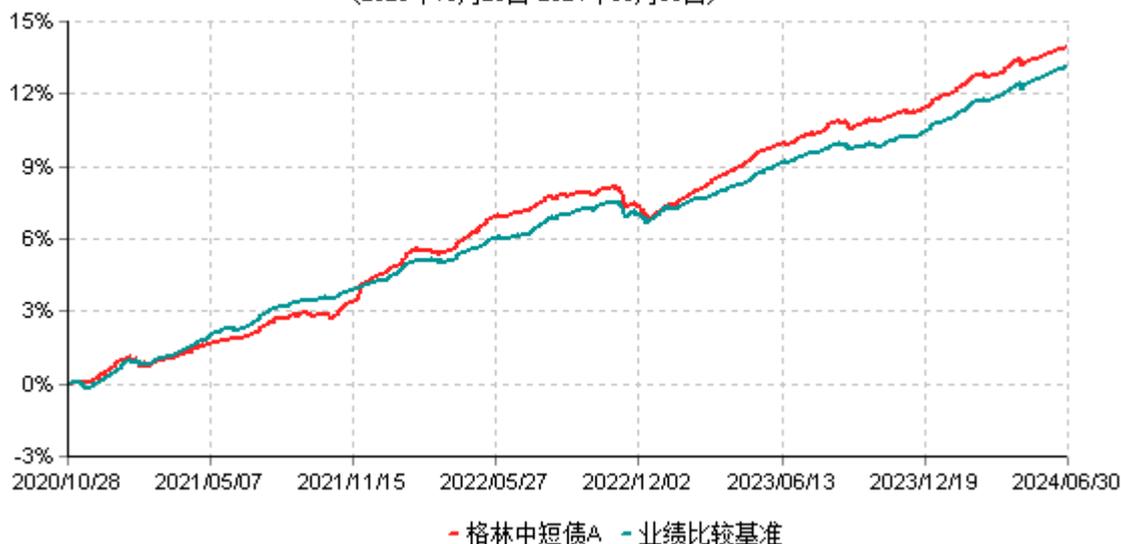
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

格林中短债C净值表现

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	0.83%	0.03%	1.09%	0.03%	-0.26%	0.00%
过去六个月	1.73%	0.03%	2.13%	0.02%	-0.40%	0.01%
过去一年	3.12%	0.03%	3.54%	0.02%	-0.42%	0.01%
过去三年	9.87%	0.04%	10.42%	0.03%	-0.55%	0.01%
自基金合同生效起至今	12.44%	0.21%	13.15%	0.03%	-0.71%	0.18%

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

格林中短债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  
(2020年10月28日-2024年06月30日)



格林中短债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10月28日-2024年06月30日)



## §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		
高洁	本基金基金经理	2020-12-02	-	12年	高洁女士，美国旧金山大学金融分析硕士。曾任吉林银行金融市场部债券交易员，民生银行直销银行事业部基金类产品经理，中英益利资产管理股份有限公司固定收益部投资经理。2020年5月加入格林基金，曾任固定收益部基金经理助理，现任基金经理。2020年12月2日至今，担任格林日鑫月熠货币市场基金基金经理；2020年12月2日至今，担任格林中短债债券型证券投资基金基金经理；2024年1月1日至今，担任泓裕一年定

					期开放债券型证券投资基金基金经理。
李玉杰	本基金基金经理	2021-08-26	2024-04-30	14年	李玉杰先生，北京航空航天大学工学硕士。曾任中国农业银行宏观研究及利率衍生品交易策略分析师，北京日盛联合资产管理有限公司投资研究总监、固定收益投资经理。2020年9月加入格林基金，负责宏观资产配置策略及固收投资策略研究，现任基金经理。2021年8月26日至2024年4月30日，担任格林中短债债券型证券投资基金基金经理；2022年11月14日至2024年4月30日，担任格林聚享增强债券型证券投资基金基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合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

报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

报告期内，基金管理人利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗（包括当日、3日内、5日内）对基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金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5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在地产政策放松的影响下，2024年5月、6月的商品房销售情况有了边际好转，5月商品房销量在一系列政策加持下创近一年新高，大部分一线城市5月成交量均有明显提升，但是价格仍没有太大变化，仍为买方市场，债市也并未对地产进行再次定价。债市的增量资金在二季度较为充沛，在4月底的调整后市场情绪一直较为谨慎，但政策预期差放大，市场累积的做多情绪在6月下旬得到一定的释放，由于目前市场流动性较为充足，市场对于降息降准的预期较之前有所淡化，息差在这样的环境下虽然呈现收缩态势但仍是较为稳定的收益来源。

组合在二季度中保持适当杠杆，整个仓位在稳定性较好，配置均衡。下半年重点关注债券供给及央行的买卖债券操作，这些变化可能带来一些情绪冲击、政策上的预期差也可能促使下半年机构的止盈止损交易操作发生变化。目前汇率也是我们重点关注的方面，逆周期调节因子也显示出调控力度较大，考虑到央行的首要任务是稳币值，警惕汇率波动对债市的冲击。近期账户操作仍注重精细化管理，机会在中短端更大，若博弈波段机会，可在曲线上寻找凸点适量配置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林中短债A基金份额净值为1.0647元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.95%，同期业绩比较基准收益率为1.09%；截至报告期末格林中短债C基金份额净值为1.0485元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.83%，同期业绩比较基准收益率为1.09%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,970,241,962.43	97.27
	其中：债券	2,970,241,962.43	97.27
	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	23,805,467.95	0.78
	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	46,326,739.69	1.52
8	其他资产	13,329,006.46	0.44
9	合计	3,053,703,176.53	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境内股票。

### 5.2.2 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。

## 5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	30,581,243.53	1.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	900,403,463.53	31.69
	其中：政策性金融债	211,982,729.70	7.46
4	企业债券	353,730,596.36	12.45
5	企业短期融资券	394,975,250.06	13.90
6	中期票据	1,073,608,303.89	37.78
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	216,943,105.06	7.63

9	其他	-	-
10	合计	2,970,241,962.43	104.53

### 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	112496480	24南京银行CD069	1,000,000	98,481,961.10	3.47
2	220217	22国开17	800,000	80,646,000.00	2.84
3	212480016	24杭州联合农商小微债01	800,000	80,045,172.60	2.82
4	2028018	20交通银行二级	700,000	71,008,809.32	2.50
5	012480199	24平安租赁SCP002	700,000	70,860,150.82	2.49

**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投资。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**  
本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
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中：

天津银行股份有限公司2023年12月5日因违反账户管理规定、未按规定履行客户身份识别义务，被中国人民银行天津市分行警告、罚款34.6万元，相关文号：津银罚决字（2023）8号。

厦门国际银行股份有限公司2023年8月7日因办理企业资本金结汇业务违规、2020年部分未结清内保外贷业务违规，被国家外汇管理局厦门市分局给予警告，合计处罚款

644.30万元人民币，没收违法所得194.00万元人民币，相关文号：厦门汇检罚〔2023〕2号；2023年9月20日因发行收益与实际承担风险不匹配的结构性存款等事由，被中国银行保险监督管理委员会厦门监管局罚款220万元，相关文号：厦金罚决字〔2023〕6号。

交通银行股份有限公司于2023年6月3日因安全测试存在薄弱环节等违法事实被国家金融监督管理总局给予罚款160万元的行政处罚。相关文号：金罚决字〔2024〕29号。

中国建设银行股份有限公司于2023年11月22日因单个网点在同一会计年度内与超过3家保险公司开展保险业务合作等违法违规事实被国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计3791.879382万元。相关文号：金罚决字〔2023〕29号。

中国建设银行股份有限公司于2023年12月27日因并表管理内部审计存在不足等违法违规事实被国家金融监督管理总局罚款170万元。相关文号：金罚决字〔2023〕41号。

南京银行股份有限公司2023年8月25日因办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理性审查；未按规定报送财务会计报告、统计报告等资料；违反外汇登记管理规定违法事实，被国家外汇管理局江苏省分局警告、罚款60万元，相关文号：苏汇检罚〔2023〕4号。

杭州联合农村商业银行股份有限公司于2023年7月13日因分支机构未经批准自行停业、报送行政许可请示材料隐瞒重要事实违法违规事实被浙江银保监局罚款30万元。相关文号：浙银保监罚决字〔2023〕20号。

除上述发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未发生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 本基金本报告期末持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。**

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,689.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,200,000.00
5	应收申购款	12,118,317.19
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	13,329,006.46

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

	格林中短债A	格林中短债C
报告期期初基金份额总额	1,635,951,900.79	21,349,324.57
报告期期间基金总申购份额	2,836,868,459.66	246,239,020.70
减：报告期期间基金总赎回份额	1,899,798,009.12	170,113,013.38
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	2,573,022,351.33	97,475,331.89

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金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

本报告期内，基金管理人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

本报告期内，基金管理人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超过20%的情况

本报告期内，本基金单一投资者持有份额比例没有达到或超过总份额20%的情况。

### 8.2 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。

## §9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予格林中短债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《格林中短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《格林中短债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《格林中短债债券型证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 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。

## 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。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。

格林基金管理有限公司  
2024年07月19日