

格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金

2026年第1季度报告

2026年03月31日

基金管理人:格林基金管理有限公司

基金托管人:恒丰银行股份有限公司

报告送出日期:2026年04月21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遵规守信情况的说明..... | 8 |
| 4.3 公平交易专项说明..... | 8 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析..... | 9 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现..... | 10 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明..... | 10 |
| §5 投资组合报告..... | 10 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况..... | 10 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 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..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 13 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 13 |
| 5.11 投资组合报告附注..... | 13 |
| §6 开放式基金份额变动..... | 14 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况..... | 15 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况..... | 15 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细..... | 15 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 16 |
| §9 备查文件目录..... | 16 |
| 9.1 备查文件目录..... | 16 |
| 9.2 存放地点..... | 16 |
| 9.3 查阅方式..... | 16 |

§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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据基金合同约定，于2026年4月20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2026年1月1日起至2026年3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 格林鑫利六个月持有期混合 |
| 基金主代码 | 017079 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023年03月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 85,223,012.64份 |
| 投资目标 | 在深入的基本面研究的基础上，通过优选在经济新常态下具有发展价值的优质企业，在严格控制投资组合风险的前提下，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的回报。 |
| 投资策略 | 本基金的主要投资策略包括资产配置策略、行业配置策略、股票投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略和其他金融工具投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*15%+中证港股通综合指数收益率*15%+中债综合财富（总值）指数收益率*65%+一年期人民币定期存款基准利率(税后)*5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，可能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 | 格林基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 恒丰银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 格林鑫利六个月持有期混合A | 格林鑫利六个月持有期混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 017079 | 017080 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 50,735,286.40份 | 34,487,726.24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(2026年01月01日 - 2026年03月31日) | |
|----------------|--------------------------------|---------------|
| | 格林鑫利六个月持有期混合A | 格林鑫利六个月持有期混合C |
| 1.本期已实现收益 | 1,417,643.12 | 948,322.04 |
| 2.本期利润 | -2,234,358.14 | -1,633,721.01 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0419 | -0.0443 |
| 4.期末基金资产净值 | 60,924,295.21 | 40,923,261.18 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2008 | 1.1866 |

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

格林鑫利六个月持有期混合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 | -3.28% | 0.41% | -0.97% | 0.33% | -2.31% | 0.08% |
| 过去六个月 | -3.45% | 0.35% | -1.56% | 0.31% | -1.89% | 0.04% |
| 过去一年 | 3.12% | 0.37% | 4.77% | 0.33% | -1.65% | 0.04% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去三年 | 20.03% | 0.37% | 15.24% | 0.33% | 4.79% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.08% | 0.36% | 16.13% | 0.33% | 3.95% | 0.03% |

格林鑫利六个月持有期混合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 | -3.38% | 0.41% | -0.97% | 0.33% | -2.41% | 0.08% |
| 过去六个月 | -3.65% | 0.35% | -1.56% | 0.31% | -2.09% | 0.04% |
| 过去一年 | 2.70% | 0.37% | 4.77% | 0.33% | -2.07% | 0.04% |
| 过去三年 | 18.62% | 0.37% | 15.24% | 0.33% | 3.38% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.66% | 0.36% | 16.13% | 0.33% | 2.53% | 0.03% |

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

格林鑫利六个月持有期混合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
(2023年03月20日-2026年03月31日)

格林鑫利六个月持有期混合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
(2023年03月20日-2026年03月31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 | | |
| 刘赞 | 本基金的基金经理、公司副总经理 | 2023-03-20 | - | 16年 | 刘赞先生，美国纽约州立大学理学硕士，曾获香港证监会颁发的4号牌（就证券提供意见）、9号牌（提供资产管理）资格。2009年06月至2012年09月任职于南方基金管理有限公司，担任研究员。2012年10月到2020年09月任职于南方东英资产管理有限公司（南方基金香港子公司），担任基金经理。2021年10月加入格林基金，现任副总经理、基金经理。2022年11月15日至今，担任格林高股息优选混合型证券投资基金基金经理；2023 |

| | | | | | |
|----|--------------------|------------|---|-----|---|
| | | | | | <p>年01月19日至今，担任格林碳中和主题混合型证券投资基金基金经理；2023年03月20日至今，担任格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2024年04月22日至今，担任格林港股通臻选混合型证券投资基金基金经理；2024年05月28日至2025年06月10日，担任格林宏观回报混合型证券投资基金基金经理；2025年09月16日，担任格林科技成长混合型证券投资基金基金经理。</p> |
| 高洁 | 本基金的基金经理、固定收益二部副总监 | 2025-09-25 | - | 13年 | <p>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05月加入格林基金，曾任固定收益部基金经理助理，现任固定收益二部副总监、基金经理。2020年12月02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02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01月11日至今，担任格林泓裕一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2024年08月13日至2025年09月25日，担任格林30天滚动持有债券型证券投资基金基金经理；20</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 24年9月20日至今，担任格林中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理；2025年05月06日至今，担任格林60天持有期债券型证券投资基金基金经理；2025年08月01日，担任格林泓盛一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2025年09月25日至今，担任格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

- 1.上述任职日期和离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
- 2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。
- 3.根据基金管理人发布于2025年11月29日的《关于基金经理高洁休假期间由他人代为履职的公告》，基金经理高洁自2025年12月1日起休产假，在其休假期间，由尹鲁晋代为履行本基金基金经理职责。

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

2026年第1季度，中国经济在“新旧动能转换”中实现平稳开局，呈现鲜明的“非对称复苏”特征。生产端与外需构成核心支撑：1-2月出口同比大增21.8%，高技术产品成为引擎，带动规模以上工业增加值同比增长6.3%。投资端呈“基建强、地产弱”格局，在专项债前置及政策性金融工具发力下，基建投资累计同比高达11.40%，有效对冲了房地产开发投资（-11.10%）的下行压力；制造业投资在政策推动下温和修复。然而，内需修复依然偏缓，1-2月社零增速仅为2.8%，且PPI与CPI持续承压，反映出经济“K型”分化与价格磨底的现实。总体而言，一季度增长由外需和基建驱动，为全年目标达成奠定基础，但内生动能全面修复仍需等待价格信号与企业盈利的实质性改善。

固收方面，回顾2026年第一季度，总的来说，以10年期国债收益率为例，曲线呈现“N”字形。细分来看，自1月第二周以来，利率下行趋势明显，无论是资金面、资产“跷跷板”效应等方面均对债市影响较小，在10年期活跃券触及1.90%以及30年期活跃券接近2.35%之后，市场配置力量明显增强，开启了震荡下行趋势。直到2月底，债券市场再次整体震荡上行，核心矛盾或在于前期利率走低后的赔率导致性价比偏低再叠加地缘冲突推高通胀预期与政策宽松的博弈。季末再度出现小幅度震荡下行，原因或在于地缘政治风险冲击下能源受限全球衰退预期的交易演化。报告期内，本基金债券部分保持中等久期，整体采用交易策略，利用市场调整时机增加长债配置并及时止盈。

权益方面，基于管理人对于国内资本市场中长期向好的积极预期，组合将权益资产仓位保持在较高水平，其余资金主要配置于流动性管理工具，以保持组合的灵活性与风险抵御能力。一季度A股市场在政策底线思维明确与居民资金“搬家”效应的共振下，展现出较强的向上韧性，市场风格呈现以科技成长和高股息红利资产为核心的“哑铃型”特征，为本组合的布局提供了有利环境。在具体布局上，本产品着重关注以下两条主线：一是围绕内需修复主线进行配置。虽然一季度社零增速仍显温和，但随着一系列促消费、扩内需政策持续推出与落地，消费行业整体景气预期正逐步改善。在经济结构转型与高质量发展的宏观背景下，内需消费将持续成为政策支持的重点方向，相关板块有望迎来盈利预期改善和估值修复的双重动力。二是继续布局高股息资产。海外地缘局势依然复杂多变，在不确定性环境中，高股息标的凭借其稳健的现金流和防御属性，具有较好的配置价值。尤其目前港股高股息板块兼具“高股息、低估值”的特征，在海外流动性环境趋于宽松、国内经济温和修复的预期下，有望迎来资金关注和估值修复空间。

展望后市：

固收方面，利率市场短期内整体仍以区间震荡为主，信用市场利差过度挤压需要一定程度注意风险。债市整体趋势性机会预计发酵时间点或于4月底、5月初，原因在于国内因为总量货币政策使用预期再度升温，海外美元指数升值可能性偏高。总的来说，短期内债市或仍呈现区间震荡的态势。本产品在策略上，仍将保持谨慎以交易思维为主，综合分析审慎博弈，保持仓位流动性，积极进行波段交易。

权益方面，宏观驱动面临从“外需拉动”向“内需接力”切换，经济增速或因高基数等因素阶段性承压。政策将更聚焦供给侧“反内卷”与产能优化，以推动PPI温和回升。资本市场定价逻辑也将从“估值修复”转向“基本面与盈利验证”。配置上维持“哑铃型”结构，一端坚守高确定性红利资产与受益于供给优化的上游资源品，另一端逢低布局“十五五”规划与科技自立自强驱动的泛AI产业链及高端制造。同时，需警惕外部地缘博弈加剧与内部房地产修复不及预期等风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林鑫利六个月持有期混合A基金份额净值为1.2008元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.28%，同期业绩比较基准收益率为-0.97%；截至报告期末格林鑫利六个月持有期混合C基金份额净值为1.1866元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.38%，同期业绩比较基准收益率为-0.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续20个工作日基金份额持有人不满200人或连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

§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 | 30,036,030.41 | 29.29 |
| | 其中：股票 | 30,036,030.41 | 29.29 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 29,458,086.92 | 28.73 |
| | 其中：债券 | 29,458,086.92 | 28.73 |
| | 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 | 36,001,479.45 | 35.11 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 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 | 7,032,379.94 | 6.86 |
| 8 | 其他资产 | 6,305.89 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 102,534,282.61 | 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

| 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 | 14,773,424.85 | 14.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| 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 | 14,773,424.85 | 14.51 |
|--|----|---------------|-------|

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 (%) |
|----------|---------------|---------------|
| 原材料 | - | - |
| 非日常生活消费品 | 5,017,452.36 | 4.93 |
| 日常消费品 | 2,243,720.66 | 2.20 |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | 2,018,529.17 | 1.98 |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 通讯业务 | - | - |
| 公用事业 | 5,982,903.37 | 5.87 |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 15,262,605.56 | 14.99 |

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

| 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 | 00384 | 中国燃气 | 371,200 | 2,343,552.64 | 2.30 |
| 2 | 002841 | 视源股份 | 70,900 | 2,310,631.00 | 2.27 |
| 3 | 603605 | 珀莱雅 | 37,900 | 2,305,078.00 | 2.26 |
| 4 | 301188 | 力诺药包 | 130,400 | 2,222,016.00 | 2.18 |
| 5 | 300777 | 中简科技 | 57,500 | 2,036,075.00 | 2.00 |
| 6 | 01951 | 锦欣生殖 | 960,500 | 2,018,529.17 | 1.98 |
| 7 | 002271 | 东方雨虹 | 127,100 | 1,945,901.00 | 1.91 |
| 8 | 02688 | 新奥能源 | 34,100 | 1,907,487.51 | 1.87 |
| 9 | 301498 | 乖宝宠物 | 37,415 | 1,907,042.55 | 1.87 |
| 10 | 00667 | 中国东方教育 | 404,500 | 1,818,013.12 | 1.79 |

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 | 19,367,574.59 | 19.02 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 10,090,512.33 | 9.91 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,090,512.33 | 9.91 |
| 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 | 29,458,086.92 | 28.92 |

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 | 2500006 | 25超长特别国债06 | 200,000 | 19,367,574.59 | 19.02 |
| 2 | 250211 | 25国开11 | 100,000 | 10,090,512.33 | 9.91 |

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：

国家开发银行因违规办理内保外贷业务、违反规定办理结汇、售汇业务、未按照规定进行国际收支统计申报等原因，2025年7月25日被国家外汇管理局北京市分局警告、没收违法所得、罚款1394.42万元，相关文号：京汇罚[2025]30号；因违反金融统计相关规定等原因，2025年9月22日被中国人民银行警告、罚款123万元，相关文号：银罚决字[2025]66号。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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 报告期内，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 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 6,305.89 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 6,305.89 |

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

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

| | 格林鑫利六个月持有期 混合A | 格林鑫利六个月持有期 混合C |
|--|-------------------|-------------------|
| | | |

| | | |
|-------------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 55,283,164.70 | 34,113,044.16 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 15,730,303.93 | 15,219,933.74 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 20,278,182.23 | 14,845,251.66 |
| 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 | 50,735,286.40 | 34,487,726.24 |

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

| 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 |
| 个人 | 1 | 20260101 - 20260331 | 20,412,153.94 | 11,852,232.32 | 0.00 | 32,264,386.26 | 37.86% |

产品特有风险

1、净值大幅波动的风险

由于本基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该投资者在开放日大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。

2、出现巨额赎回的风险

该投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回延缓支付赎回款项。其他投资者的赎回申请也可能同时面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行延缓支付的风险。当连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。

3、基金规模过小的风险

根据基金合同的约定，基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。该投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5,000万元情形。

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鑫利六个月持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《格林鑫利六个月持有期混合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

2026年04月21日