

格林宏观回报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:交通银行股份有限公司

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	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	7
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	14
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	14
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	14
§8 影响投资者决策的其他重要信息	14
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	14
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	14
§9 备查文件目录	14
9.1 备查文件目录	15
9.2 存放地点	15
9.3 查阅方式	15

§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。

基金托管人交通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	格林宏观回报混合
基金主代码	020062
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年05月28日
报告期末基金份额总额	369,397,419.02份
投资目标	在深入研究经济、行业周期和上市公司的基础上，在严格控制风险和保障必要流动性大前提下，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金采取的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*70%+恒生指数收益率*10%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金还可以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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	格林宏观回报混合A	格林宏观回报混合C
下属分级基金的交易代码	020062	020063
报告期末下属分级基金的份额总额	274,817,830.72份	94,579,588.30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)	
	格林宏观回报混合A	格林宏观回报混合C
1.本期已实现收益	50,170,294.11	14,715,562.44
2.本期利润	-10,781,982.92	-5,707,902.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0330	-0.0527
4.期末基金资产净值	437,719,627.48	149,370,768.08
5.期末基金份额净值	1.5928	1.5793

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

格林宏观回报混合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	-6.15%	1.87%	-3.06%	0.78%	-3.09%	1.09%
过去六个月	-8.99%	1.77%	-3.61%	0.76%	-5.38%	1.01%
过去一年	29.69%	1.71%	11.01%	0.79%	18.68%	0.92%
自基金合同	63.97%	1.73%	20.41%	0.92%	43.56%	0.81%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

格林宏观回报混合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	-6.27%	1.87%	-3.06%	0.78%	-3.21%	1.09%
过去六个月	-9.22%	1.77%	-3.61%	0.76%	-5.61%	1.01%
过去一年	29.05%	1.71%	11.01%	0.79%	18.04%	0.92%
自基金合同生效起至今	62.60%	1.73%	20.41%	0.92%	42.19%	0.81%

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

格林宏观回报混合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
(2024年05月28日-2026年03月31日)



格林宏观回报混合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
(2024年05月28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		
郑中华	本基金的基金经理、公司总经理助理、权益投资总监	2024-05-28	-	10年	郑中华先生，中央财经大学金融学博士。曾任兴业银行总行投资部宏观策略研究员，英大基金管理有限公司权益投资部宏观策略研究员、基金经理、部门总助。2023年02月加入格林基金，现任总经理助理、权益投资总监、基金经理。2024年05月28日至今，担任格林宏观回报混合型证券投资基金基金经理；2025年05月23日至今，担任格林研究优选混合型证券投资基金基金经理；2026年03月27日至今，担任格林上证科创板综合

					指数增强型证券投资基金 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。

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

2026年第一季度，市场整体收跌。具体到月度范围来看，1月和2月市场震荡上行，3月大幅下行并导致季度市场最终收跌。总体来看，市场总体有效，具体分析如下：

2026年1月，市场呈现“连续上行继而高位震荡”的结构特征。影响市场的重要因素包含全球金融环境、全球地缘政治风险和国内监管层“高位控温”等因素：在流动性持续宽松的影响下，市场延续2025年12月下旬的行情，实现了创造历史的17连阳。从国内基本面来看，经济数据仍相对孱弱，并未对指数上行形成乐观指引。从海外金融市场来看，日本和韩国同样实现开门红并持续创历史新高，全球金融市场环境相对友好。最

后，从流动性来看，市场日均交易量和两融余额显著抬升，流动性抬升所引发的估值上行是指数上行的核心引擎。1月中旬至下旬，市场开始高位震荡，行业分化极其严重。大型权威资金每日盘中对多种重要的指数和行业ETF进行日内交易，降低市场温度。在监管偏好的影响下，虽然指数在1月中下旬总体相对稳定，但行业之间的相对涨跌幅却出现显著分化：第一，涨价型行业不分缘由地被快速定价。第二，成长科技型行业在1月中下旬总体跑输市场。由于持续降温，特别是对于0-1的快速成长型行业，被定义为“概念炒作”而持续降温，主要影响的行业包含商业航天和AI的软件应用。

2026年2月，市场总体上涨，呈现“上中旬下行震荡，下旬上行”的结构特征，影响市场的重要因素包含监管降温、全球地缘政治风险不断发酵和中国科技突围等因素：在持续降温后，市场交易热度和价格逐渐开始下行。2月中旬，市场总体震荡为主。从交易层面来看，临近春节市场自发交易热情有所降低。从基本面来看，月度通胀数据印证短期国内经济特别是需求端压力仍较大，市场缺乏方向性指引。2月下旬，市场再度震荡上行，地缘政治风险和中国科技突围是上行的主要驱动力。首先，春节期间，以韩国和日本为主的市场再创历史新高，对国内市场形成带动效应。其次，近期国际报告显示，国内大模型的全球调用量，以极致的性价比首次超越美国，增加了风险偏好。

2026年3月，市场在高波动中大幅下行，美伊战争的逐渐升级，为全球资本市场蒙上阴影：3月上旬，在“闪电战”和“快速斩首”的预期下，资本市场在快速下行后仍能实现一定反弹。在战争初期，市场将美伊战争类比为前期的“委内瑞拉”事件，认为整体战事会在较短时间内得以逐渐降温。在这种预期下，虽然市场在美伊开战的前期出现暴跌，但在美国对伊朗前任领导团队实现大规模斩首的过程中，整体市场亦实现了显著反弹。从行业上来看，市场对经济的定位集中于通胀抬升，对经济的损伤极为有限。伴随布伦特原油价格快速冲高，石油化工显著受益于战事的短期升级；相比之下，由于整体战争预期相对可控，对经济和货币政策的影响有限，TMT和先进制造等行业虽然出现大幅回落，但亦有显著反弹。3月中下旬，伴随美伊战争的持续时间和烈度不断超预期，市场总体显著承压。伴随伊朗对霍尔木兹海峡封锁时间的不断延长，原油价格持续运行在100美金/每桶的价格之上。全球原油库存逐渐减少后，市场开始担忧美伊战争对全球经济的系统性和中长期冲击，全球经济面临由“滞胀”转向“衰退”的风险。在这种悲观预期下，未来经济下行风险逐渐增加，但降息的空间逐渐减少，市场面临短期的“戴维斯双杀”。伴随着战事持续时间的不断增加，几乎没有任何行业会受益于战争升级，区别仅在于负面冲击的程度。对于原油和化工来说，虽然短期会因为战争而进一步抬升原油价格，但是战事对经济的损伤会进一步降低相关行业在未来的盈利预期，亦即“短多长空”。对于TMT和先进制造而言，主要受损于全球货币政策和流动性的收紧预期。因此，布伦特原油价格维持在100美金/桶的时间越长，战事对经济的损伤越大。

综合来看，2026年1季度市场定价因素极其复杂。1月市场上涨的原因主要包含流动性宽松和全球资本市场上行的友好环境。2月市场延续上涨的因素主要涵盖地缘政治风险和中国的科技突围。3月市场显著下跌的原因集中于美伊战争及其边际变化。综上所述，2026年一季度市场整体下跌，事后站在上帝视角进行回顾来看，整体市场仍然是有

效的。但是，投资交易角度来看的难度极大，影响市场上行和下行的因素基本都源于市场外部，包含地缘政治风险和监管态度等。相关因素都具备典型的不可预期性，而不可预期本身就意味着一定风险，因此市场波动和行业轮动均较难预期。

2026年一季度，本基金在资产配置上维持了稳定特征，基本没有进行大类资产维度的调整，重点调整方向为权益资产内部行业之间的结构占比。截至季度末，权益仓位均值为92%。A股占86%，港股占6%，现金比例8%。

行业方面，基金在1至2月维持了“科技+红利+反内卷”的三元结构，只有在3月份美伊战事发酵的不同阶段，进行了不同操作。在战事发生的前期，基于2025年4月初和10月初中美贸易战的市场情况及行业股价变动，基金在市场恐慌阶段左侧加仓了核心科技，右侧出清石油石化。在3月底战事烈度达到较高水平时，基金在三元投资结构未变的情况下，进行了科技内部调整结构。维持“科技+红利+反内卷”的三元结构，比例结构约为【75%，10%，15%】。科技≈底座+AI应用，两者在科技类占比相当；底座≈算力+AIDC+固态，AI应用≈智驾+人形机器人+商业航天。在科技类行业大幅波动中，基金将之前持仓的AI的各类软件应用逐渐出清，重新分配至各类AI底座和AI的硬件应用当中。红利≈旅游+钢铁。反内卷≈新能源+光伏。

2026年二季度，总体认为会出现修复性行情，指数震荡上行。

首先，经济的温和复苏为指数的中长期上行奠定基础。从宏观经济整体观察来看，国内经济整体目前处于温和复苏阶段。复苏是指中国在2026年有较大概率摆脱通缩而迈向通胀，通过近期公布的通胀数据可以得到进一步证明。与此同时，我们看到的是温和式而非显著性的快速复苏。一方面，在2025年消费补贴在下半年有所减少以后，我们观察到下半年的实际GDP逐季下降，说明经济的复苏仍然主要依托于政策托底而非经济自身的正向循环，自身造血能力仍有所欠缺。另一方面，刚刚开完的两会公布了2026年的政府工作目标，总体的政策基调仍体现为“稳健和托底”而非积极复苏，因此2026年预期经济的复苏力度仍相对温和。

其次，地缘政治风险特别是美伊战争的定价接近后期，市场存在反弹诉求。根据最新研究报告和专家路演，我们分三种情况对于美伊战争进行展望。基准预期：战争维持目前烈度，在4月上旬达到高潮后逐渐降温，布伦特原油维持在100-110美金/桶；悲观预期：战争烈度再度显著抬升，布伦特原油上涨至130美金/桶甚至更高；乐观预期：战争烈度降温显著超预期，布伦特原油下跌至90美金/桶。在基准预期的假设下，预期指数在宽幅震荡后逐渐开启修复：基准情形假设下，美伊战争有可能仍会边际升温，但升温力度较前期有所降低，对市场的影响有所钝化。短期来看，虽然美以仍有可能通过地面部队升级战事，甚至有可能对伊朗的民用设施和哈尔克岛进行打击。但是，升级可能更多意味着“以打促谈”而非重演“中东泥潭”。除此之外，通过美国和伊朗表态来看，双方虽然仍在激烈交火，且双方提出的停火要求均无法被对方接受。但是，已经逐渐开始建立沟通渠道，且霍尔木兹海峡开始了稍许的通行信号。中长期来看，美国总统预期将于5月中旬访问中国，且面临国内反战的庞大压力，特朗普政府的支持率也再创新低，美国资本市场近期显著承压，这些因素都为结束战事提供有利条件。因此，战争本身可

能度过了最悲观的预期，对市场的影响有所钝化和减弱。基准情形假设下，资本市场已经接近充分地Price-IN了美伊战争和经济的悲观展望。从跌幅来看，指数下跌的维持时间和下跌幅度，均极度类似于2025年10月中美贸易战的情况，指数和行业的最大回撤均相对接近，基本已经反映了目前的美伊冲突烈度和经济悲观展望。基于预期来看，指数有可能于4月上旬后期开始反弹。从行业来看，预期反弹过程中，指数和行业的相对涨跌幅，于战争升级阶段形成显著的“跷跷板效应”，TMT和先进制造有可能表现出较好的绝对和相对收益。

综合而言，预期2026年二季度，市场会逐渐筑底企稳反弹。短期来看，市场的上涨和下行，主要影响因素仍是美伊战争及其变化态势。从投资而言，已经较为充分地定价了目前冲突烈度较高的基准假设。中期来看，在经济温和复苏及上市公司业绩平稳增长的情况下，对市场应抱有合理的修复预期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林宏观回报混合A基金份额净值为1.5928元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.15%，同期业绩比较基准收益率为-3.06%；截至报告期末格林宏观回报混合C基金份额净值为1.5793元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-6.27%，同期业绩比较基准收益率为-3.06%。

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	551,461,768.09	93.64
	其中：股票	551,461,768.09	93.64
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	36,877,595.24	6.26
8	其他资产	582,805.36	0.10
9	合计	588,922,168.69	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	447,306,860.51	76.19
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	11,930,175.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	64,367,597.45	10.96
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	7,290,680.80	1.24
N	水利、环境和公共设施 管理业	2,388,870.00	0.41
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	6,972,030.00	1.19

	合计	540,256,213.76	92.02
--	----	----------------	-------

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	6,660,124.63	1.13
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	4,545,429.70	0.77
通讯技术	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	11,205,554.33	1.91

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	002475	立讯精密	167,300	8,241,198.00	1.40
2	300450	先导智能	156,500	7,465,050.00	1.27
3	600673	东阳光	230,100	6,972,030.00	1.19
4	300017	网宿科技	407,900	6,893,510.00	1.17
5	600498	烽火通信	134,700	6,799,656.00	1.16
6	600602	云赛智联	290,100	6,739,023.00	1.15
7	300738	奥飞数据	305,200	6,662,516.00	1.13
8	688025	杰普特	30,345	6,478,657.50	1.10
9	300383	光环新网	358,700	6,140,944.00	1.05
10	601111	中国国航	900,000	6,057,000.00	1.03

5.4 报告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投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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本期未发生被监管部门立案调查，或者在本报告编制日起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	20,441.68
4	应收利息	-
5	应收申购款	562,363.68
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	582,805.36

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

报告期末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

	格林宏观回报混合A	格林宏观回报混合C
报告期期初基金份额总额	532,930,394.81	168,990,741.04
报告期期间基金总申购份额	50,621,898.09	31,299,117.09
减：报告期期间基金总赎回份额	308,734,462.18	105,710,269.83
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	274,817,830.72	94,579,588.30

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宏观回报混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《格林宏观回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《格林宏观回报混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《格林宏观回报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