

格林港股通臻选混合型证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:格林基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2024年10月24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	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	6
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	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	10
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	11
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	11
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	11
§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	12
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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据基金合同约定，于2024年10月23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7月1日起至2024年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	格林港股通臻选混合型证券投资基金	
基金主代码	017000	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年04月22日	
报告期末基金份额总额	1,046,215.44份	
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，精选长期业绩优秀、质地优良的上市公司股票，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
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、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资业务策略。	
业绩比较基准	中证港股通综合指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+一年期人民币定期存款基准利率（税后）*10%	
基金管理人	格林基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	格林港股通臻选混合A	格林港股通臻选混合C
下属分级基金的交易代码	017000	017001
报告期末下属分级基金的份额总额	357,497.42份	688,718.02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07月01日 - 2024年09月30日)	
	格林港股通臻选混合 A	格林港股通臻选混合 C
1.本期已实现收益	3,553.09	12,620.66
2.本期利润	76,875.57	135,583.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.1982	0.0326
4.期末基金资产净值	416,154.77	800,483.30
5.期末基金份额净值	1.1641	1.1623

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

格林港股通臻选混合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	21.65%	1.63%	13.84%	1.23%	7.81%	0.40%
自基金合同 生效起至今	16.41%	1.34%	22.13%	1.16%	-5.72%	0.18%

格林港股通臻选混合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	21.59%	1.63%	13.84%	1.23%	7.75%	0.40%

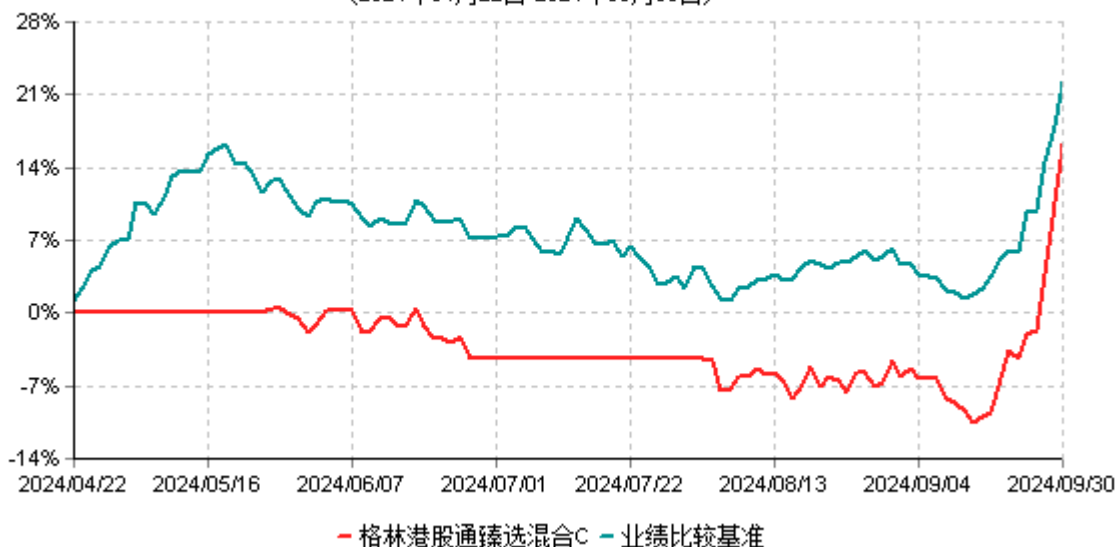
自基金合同生效起至今	16.23%	1.34%	22.13%	1.16%	-5.90%	0.18%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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

格林港股通臻选混合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04月22日-2024年09月30日)



格林港股通臻选混合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04月22日-2024年09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	证券	说明
----	----	--------	----	----

		基金经理期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
刘赞	副总经理、本基金基金经理	2024-04-22	-	15	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6月至2012年9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9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，现任公司副总经理。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年1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3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4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5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。

- 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

（一）管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明

为了应对市场的变化，管理人积极对账户进行调整，坚持以安全垫的思路建仓，自下而上精选具备估值修复、新消费、新零售业态的企业。即便在宏观消费环境承压的背景下，一些消费龙头企业依然展现出良好的基本面，其中一些可选消费公司也显示出了强劲的逆周期增长势头，随着市场对国内宏观数据修复和宏观政策的期待增加，投资者对消费股的信心增强，这可能推动消费股的进一步上涨。从行业配置上，坚持行业中性和个股相对分散的投资思路，价值和成长兼顾，平滑收益，实现净值稳步上升。在市场波动中对组合持仓进行优化和行业分散化，努力弱化组合与市场波动的相关度，尽力实现超额收益。

（二）管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

9月下旬美联储进入降息周期，海外资金对港股的关注度开始提高，同时内地政策窗口打开引发市场情绪高涨，港股投资再次引发全球资金再平衡。在经历了国庆假期连续几个交易日的上涨后，假期结束后港股高开低走，连续回调，恒生指数的跌幅一度接近10%。从近期交易量来看，恒生指数单日最大成交额超过5500亿港元，创造了新的交易记录。自美联储加息以来，港股饱受流动性因素影响，持续出现回调，而今年以来港股连续两轮的涨幅也使得部分投资者有动机在实现股价修复后进行获利了结。

尽管近期市场处于较大波动当中，投资者意见出现分歧，但是结合历史宏观面对比来看，我国政府在货币政策和财政政策方面均表现出了较为积极的应对措施，计划将推出一揽子政策工具来增强投资者信心并吸引外资流入。此外全球经济复苏的不同程度，尤其是美国宽松货币政策背景下的市场流动性得以缓解，这些也增强了投资者对高风险资产的偏好。宏观层面的边际变化有望带来港股和A股市场更为显著的震荡反转，尤其于港股而言具有稀缺的核心标的，包括互联网、生物医药、教育、新消费等新兴服务和消费业领域。然而需要警惕的是，本轮涨幅主要为资金面所带来的估值修复行情，从EPS角度来看，由于国内宏观经济仍处于恢复当中，短期政策效果对于整体经济环境的改善存在时滞，因此三四季度微观企业业绩依旧承压。随着业绩期的到来，前期情绪预计有所回落。此外，美国大选周期内港美股市场联动效应对港股市场带来的潜在扰动，因此在资产配置过程中仍需遵循谨慎原则。总体来看，前期市场由于情绪面的问题使得整体估值处于均值以下的相对位置，预期后续随着经济刺激政策及具体刺激措施的落地和实施，市场风险偏好有望重新提升。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林港股通臻选混合A基金份额净值为1.1641元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.65%，同期业绩比较基准收益率为13.83%；截至报告期末格林港股通臻选混合C基金份额净值为1.1623元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.59%，同期业绩比较基准收益率为13.83%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至报告期末，本基金存在连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人和基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

§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	979,721.00	75.48
	其中：股票	979,721.00	75.48
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	284,184.35	21.89
8	其他资产	34,093.87	2.63
9	合计	1,297,999.22	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

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	425,498.80	34.97
日常消费品	218,657.43	17.97
能源	-	-
金融	58,644.24	4.82
医疗保健	47,192.25	3.88
工业	-	-
信息技术	87,867.48	7.22
通讯业务	-	-
公用事业	141,860.80	11.66
房地产	-	-
合计	979,721.00	80.53

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	09896	名创优品	3,200	106,861.23	8.78
2	09868	小鹏汽车—W	2,100	99,953.19	8.22
3	00291	华润啤酒	3,000	91,687.80	7.54

4	02382	舜宇光学科技	1,700	87,867.48	7.22
5	00667	中国东方教育	30,500	83,071.84	6.83
6	06969	思摩尔国际	7,000	81,170.67	6.67
7	02688	新奥能源	1,400	75,570.52	6.21
8	02313	申洲国际	1,100	69,759.13	5.73
9	00384	中国燃气	10,200	66,290.28	5.45
10	01316	耐世特	22,000	65,853.41	5.41

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。

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。

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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	3,505.03
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,588.84
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	34,093.87

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

	格林港股通臻选混合A	格林港股通臻选混合C
报告期期初基金份额总额	433,014.49	11,109,902.96
报告期期间基金总申购份额	72,944.13	213,291.96
减：报告期期间基金总赎回份额	148,461.20	10,634,476.90
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	357,497.42	688,718.02

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，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§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
机构	1	20240701-20240728	5,231,767.29	-	5,231,767.29	-	-
个人	1	20240701-20240730	5,231,767.29	-	5,231,767.29	-	-
产品特有风险							
<p>1、净值大幅波动的风险</p> <p>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。因此该机构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。</p> <p>2、出现巨额赎回的风险</p> <p>该机构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。</p> <p>3、基金规模过小的风险</p> <p>根据基金合同的约定，基金合同生效后，在开放期最后一个开放日，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5000万元的，基金合同终止。该机构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低于5,000万元情形。</p>							

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港股通臻选混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《格林港股通臻选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《格林港股通臻选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《格林港股通臻选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

2024年10月24日