

格林鑫利六个月持有期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:恒丰银行股份有限公司

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	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	8
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	9
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	9
§5 投资组合报告	9
5.1 报告期末基金资产组合情况	9
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	10
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	11
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	11
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	12
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	12
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	12
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	12
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	12
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	12
5.11 投资组合报告附注	12
§6 开放式基金份额变动	13
§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	14
9.2 存放地点	14
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。

基金托管人恒丰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	8,098,577.30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	684,783.33份	7,413,793.97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	3,446.42	26,769.40
2.本期利润	30,218.91	308,412.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0437	0.0392
4.期末基金资产净值	725,887.34	7,811,983.83
5.期末基金份额净值	1.0600	1.0537

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	4.36%	0.49%	5.26%	0.38%	-0.90%	0.11%
过去六个月	3.93%	0.44%	7.41%	0.32%	-3.48%	0.12%
过去一年	4.99%	0.38%	7.91%	0.32%	-2.92%	0.06%
自基金合同	6.00%	0.31%	7.71%	0.31%	-1.71%	0.00%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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	4.25%	0.49%	5.26%	0.38%	-1.01%	0.11%
过去六个月	3.73%	0.44%	7.41%	0.32%	-3.68%	0.12%
过去一年	4.59%	0.38%	7.91%	0.32%	-3.32%	0.06%
自基金合同生效起至今	5.37%	0.31%	7.71%	0.31%	-2.34%	0.00%

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-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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘赞	副总经理、本基金基金经理	2023-03-20	-	15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1

					9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。
索隽石	本基金基金经理	2024-04-24	-	14年	索隽石先生，北京大学软件工程专业硕士，曾先后在信达证券、中信建投基金、平安信托、天风证券和天风（上海）证券资管任职，分别担任投资经理、基金经理、投资主办等职务，2023年11月加入格林基金，任特定客户资产管理部绝对收益策略部总监，现任固定收益二部基金经理。2024年4月24日至今，担任格林泓泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2024年4月24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。

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

增强组合方面，本基金截至9月末，股票仓位在29%左右。本季度的投资以高股息方向为主，自下而上精选具备估值修复、高分红且具有稳定盈利的公司。从行业配置上，坚持行业中性 and 个股相对分散的投资思路，价值和成长兼顾，平滑收益，力争实现净值稳步上升。

固收方面，第三季度内，考虑到人民币汇率等资产价格、股债风险收益比及整体市场研判，本基金维持了较高的权益类资产配置占比，固收类资产以配置中短期限品种为主。

（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，国内政策窗口的开启激发了市场情绪，但国庆节后的回调又导致市场意见出现分歧。尽管近期市场波动较大，但对比历史宏观环境，我国政府在货币政策和财政政策上均采取了积极的应对措施，计划推出一系列政策工具以增强投资者信心并吸引外资。此外，全球经济复苏的不均衡，特别是美国宽松货币政策带来的市场流动性改善，也提升了投资者对高风险资产的偏好。这些宏观层面的边际变化有望推动资本市场出现更显著的震荡反转。

然而，需要警惕的是，本轮上涨主要是资金面推动的估值修复行情。从盈利（EPS）角度看，由于国内宏观经济仍在恢复中，短期政策效果对整体经济环境的改善存在滞后

效应，因此四季度微观企业业绩仍面临压力。随着业绩期的临近，前期市场情绪预计会有所回落。同时，美国CPI数据的环比变化，以及大选周期内的市场联动效应也可能对资本市场带来潜在扰动。因此，在资产配置过程中仍需保持谨慎原则。总体来看，前期市场情绪导致市场整体估值处于相对低位。随着后续经济刺激政策及具体措施的落地和实施，市场风险偏好有望重新提升。

固收方面，由于未来几个月降准、降息（LPR）的概率仍然存在，广义基金的配置需求仍在，中短端标的收益确定性较高。信用债利差大概率维持低位，但信用下沉的风险收益比较差。长端和超长端继续受到供求、地产政策和基本面等多重因素的扰动，方向略偏不利。

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1.0600元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.36%，同期业绩比较基准收益率为5.26%；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1.0537元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.25%，同期业绩比较基准收益率为5.26%。

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	2,500,700.72	29.13
	其中：股票	2,500,700.72	29.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,328,713.97	15.48
	其中：债券	1,328,713.97	15.48
	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	4,611,393.16	53.71
8	其他资产	144,941.88	1.69
9	合计	8,585,749.73	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	1,041,035.36	12.19
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	228,060.00	2.67
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	1,269,095.36	14.86

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	278,973.61	3.27
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	338,714.51	3.97
医疗保健	140,821.67	1.65
工业	-	-
信息技术	-	-
通讯业务	-	-
公用事业	473,095.57	5.54
房地产	-	-
合计	1,231,605.36	14.43

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	301188	力诺特玻	15,900	242,634.00	2.84
2	603508	思维列控	10,756	231,899.36	2.72
3	603565	中谷物流	25,340	228,060.00	2.67
4	00384	中国燃气	35,000	227,466.65	2.66
5	00667	中国东方教育	67,500	183,847.52	2.15
6	00388	香港交易所	600	175,932.71	2.06
7	688376	美埃科技	5,000	169,350.00	1.98
8	300718	长盛轴承	9,700	164,706.00	1.93
9	01299	友邦保险	2,600	162,781.80	1.91
10	002841	视源股份	3,900	143,754.00	1.68

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	1,328,713.97	15.56
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	1,328,713.97	15.56

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	019727	23国债24	13,000	1,328,713.97	15.56

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：

中谷物流2024年2月3日因募集资金管理和使用不规范被上海监管局采取出具警示函的行政监管措施。相关文号：沪证监决[2024]32号。

中谷物流2024年7月29日因船舶未依法悬挂国旗，或者违法悬挂其他国家、地区或者组织的旗帜被中华人民共和国浦东海事局处以人民币3万元罚款，行政处罚决定书号

为海事罚字（2024）010700047412；2024年8月1日因违反《中华人民共和国行政处罚法》第三十三条第一款被中华人民共和国吴淞海事局给予警告的行政处罚，行政处罚决定书号为海事罚字（2024）010100068311。

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。

本报告期内，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	134,261.08
3	应收股利	10,680.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	144,941.88

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	693,573.51	7,989,670.70
报告期期间基金总申购份额	1,489.20	212,036.80

减：报告期期间基金总赎回份额	10,279.38	787,913.53
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	684,783.33	7,413,793.97

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

2024年10月24日