

# 格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 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:恒丰银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年1月1日起至2025年6月30日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| §4 管理人报告                                | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 15 |
| 6.1 资产负债表                               | 15 |
| 6.2 利润表                                 | 17 |
| 6.3 净资产变动表                              | 18 |
| 6.4 报表附注                                | 20 |
| §7 投资组合报告                               | 47 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 48 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 48 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 49 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51 |
| 7.6 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      | 51 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 52 |
| 7.8 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贵金属投资明细   | 52 |
| 7.9 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      | 52 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 52 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 52 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 52 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 53 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 53 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 54 |

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 54 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 54 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 55 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....  | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 56 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 56 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 56 |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 57 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 57 |
| 11.1 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..... | 57 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....               | 58 |
| §12 备查文件目录.....                         | 58 |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 58 |
| 12.2 存放地点.....                          | 58 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 58 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                 |                     |                |
|-----------------|---------------------|----------------|
| 基金名称            | 格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金 |                |
| 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         |                |
| 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          |                |
| 报告期末基金份额总额      | 59,401,981.17份      |                |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                |
| 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 | 36,487,631.88份      | 22,914,349.29份 |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                      |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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、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。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                                        | 基金托管人                   |
|---------|------|----------------------------------------------|-------------------------|
| 名称      |      | 格林基金管理有限公司                                   | 恒丰银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 高永红                                          | 梁明                      |
|         | 联系电话 | 010-50890706                                 | 021-63890689            |
|         | 电子邮箱 | gaoyonghong@china-greenfund.com              | liangming@hfbank.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 4001000501                                   | 95395                   |
| 传真      |      | 010-50890775                                 | 021-63890708            |
| 注册地址    |      | 北京市朝阳区景华南街5号18层（实际楼层15层）1802、1803、1805、1806  | 济南市历下区泺源大街8号            |
| 办公地址    |      | 北京市朝阳区景华南街5号远洋光华国际C座15层（电梯层18层）02、03、05、06单元 | 上海市黄浦区开平路88号瀛通绿地大厦16楼   |
| 邮政编码    |      | 100020                                       | 200023                  |
| 法定代表人   |      | 高永红                                          | 辛树人                     |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                               |
|---------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报                                                                          |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.china-greenfund.com/">http://www.china-greenfund.com/</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 北京市朝阳区景华南街5号远洋光华国际C座15层（电梯层18层）02、03、05、06单元                                  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                                         |
|--------|------------|----------------------------------------------|
| 注册登记机构 | 格林基金管理有限公司 | 北京市朝阳区景华南街5号远洋光华国际C座15层（电梯层18层）02、03、05、06单元 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期<br>(2025年01月01日-2025年06月30日) |                   |
|---------------|----------------------------------|-------------------|
|               | 格林鑫利六个月持<br>有期混合A                | 格林鑫利六个月持<br>有期混合C |
| 本期已实现收益       | 293,154.94                       | 273,122.66        |
| 本期利润          | 1,363,810.10                     | 1,141,265.01      |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0935                           | 0.0896            |
| 本期加权平均净值利润率   | 8.02%                            | 7.79%             |
| 本期基金份额净值增长率   | 10.70%                           | 10.47%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2025年06月30日)            |                   |
| 期末可供分配利润      | 2,178,290.89                     | 1,142,126.62      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0597                           | 0.0498            |
| 期末基金资产净值      | 43,525,263.15                    | 27,094,613.20     |
| 期末基金份额净值      | 1.1929                           | 1.1824            |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2025年06月30日)            |                   |
| 基金份额累计净值增长率   | 19.29%                           | 18.24%            |

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

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

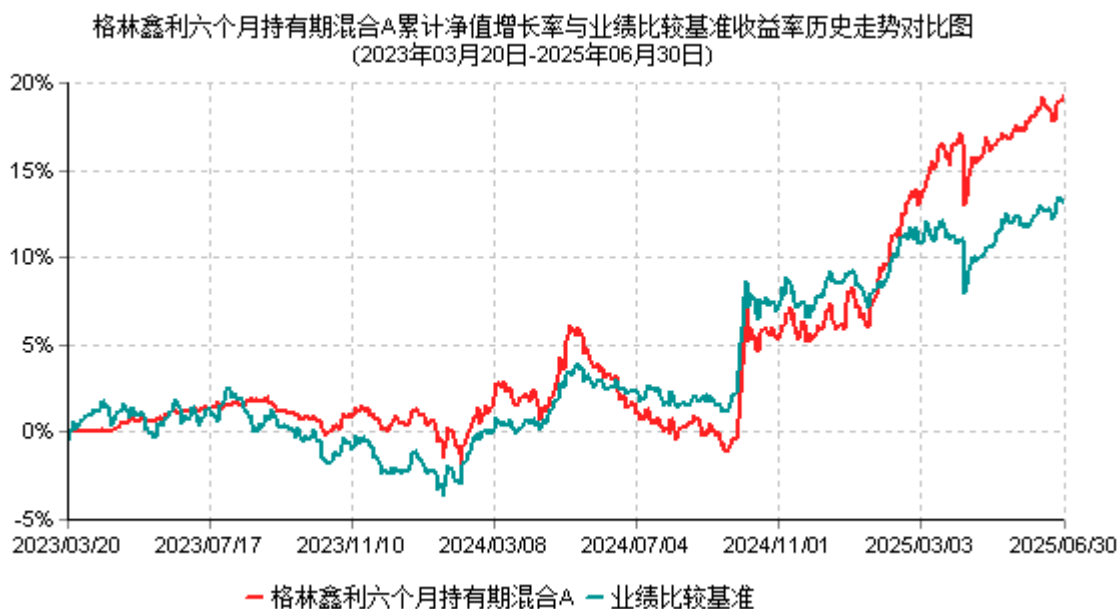
格林鑫利六个月持有期混合A

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|-------|
| 过去一个月          | 1.37%        | 0.25%               | 1.22%              | 0.22%                     | 0.15% | 0.03% |
| 过去三个月          | 2.44%        | 0.49%               | 2.07%              | 0.43%                     | 0.37% | 0.06% |
| 过去六个月          | 10.70%       | 0.45%               | 3.72%              | 0.39%                     | 6.98% | 0.06% |
| 过去一年           | 17.45%       | 0.48%               | 10.56%             | 0.39%                     | 6.89% | 0.09% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 19.29%       | 0.37%               | 13.13%             | 0.34%                     | 6.16% | 0.03% |

格林鑫利六个月持有期混合C

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|-------|
| 过去一个月          | 1.34%        | 0.25%               | 1.22%              | 0.22%                     | 0.12% | 0.03% |
| 过去三个月          | 2.34%        | 0.49%               | 2.07%              | 0.43%                     | 0.27% | 0.06% |
| 过去六个月          | 10.47%       | 0.45%               | 3.72%              | 0.39%                     | 6.75% | 0.06% |
| 过去一年           | 16.99%       | 0.48%               | 10.56%             | 0.39%                     | 6.43% | 0.09% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 18.24%       | 0.37%               | 13.13%             | 0.34%                     | 5.11% | 0.03% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为格林基金管理有限公司，于2016年10月8日正式获得中国证监会批准设立，批复文号为：证监许可〔2016〕2266号《关于核准设立格林基金管理有限公司的批复》。2016年11月1日，公司完成工商行政注册，取得《营业执照》。2016年11月

16日，取得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。格林基金股东为河南省安融房地产开发有限公司，注册资本为人民币20000万元整，注册地为北京市朝阳区景华南街5号18层（实际楼层15层）1802、1803、1805、1806。经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2025年6月30日，格林基金管理有限公司共管理33只公募基金，分别为格林日鑫月熠货币市场基金、格林伯元灵活配置混合型证券投资基金、格林泓鑫纯债债券型证券投资基金、格林伯锐灵活配置混合型证券投资基金、格林创新成长混合型证券投资基金、格林泓泰三个月定期开放债券型证券投资基金、格林泓裕一年定期开放债券型证券投资基金、格林泓远纯债债券型证券投资基金、格林泓利增强债券型证券投资基金、格林稳健价值灵活配置混合型证券投资基金、格林中短债债券型证券投资基金、格林泓安63个月定期开放债券型证券投资基金、格林泓景债券型证券投资基金、格林鑫悦一年持有期混合型证券投资基金、格林研究优选混合型证券投资基金、格林新兴产业混合型证券投资基金、格林泓皓纯债债券型证券投资基金、格林高股息优选混合型证券投资基金、格林聚鑫增强债券型证券投资基金、格林碳中和主题混合型证券投资基金、格林泓旭利率债债券型证券投资基金、格林聚享增强债券型证券投资基金、格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金、格林泓盛一年定期开放债券型发起式证券投资基金、格林聚合增强债券型证券投资基金、格林泓盈利率债债券型证券投资基金、格林港股通臻选混合型证券投资基金、格林宏观回报混合型证券投资基金、格林聚利增强一个月持有期债券型证券投资基金、格林中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、格林泓卓利率债债券型证券投资基金、格林30天滚动持有债券型证券投资基金、格林60天持有期债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务              | 任本基金的基金经理（助理）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 |

|     |          |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|----------|------------|---|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |   |     | <p>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。</p> |
| 索隽石 | 本基金的基金经理 | 2024-04-24 | - | 15年 | <p>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，现任基金经理。2024年04月24日至今，担任格林泓泰三个月定期</p>                                                                                                                                                |

|  |  |  |  |  |                                                                                                 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 开放债券型证券投资基金基金经理；2024年04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；2024年11月29日至今，担任格林30天滚动持有债券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》和其他有关法律法规的规定，以及本基金《基金合同》约定，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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

固收方面，2025年初国债收益率在到达1.6%的关键位置后，一度出现30bp幅度的上行。主要驱动因素如下：1、资金面在春节后并没有“如期”转松。资金利率及存单价格出现上行，收益率曲线出现平坦化甚至倒挂。2、宏观风险偏好出现改善。人民币汇率出现阶段升值、大宗商品震荡，股市活跃度提升，从风险偏好角度对债市有一定压制。3、机构心态变化。在低回报、扰动多、负 Carry 之下，投资者分歧加剧。2025年4月初，特朗普的“对等关税”政策引发了市场对外需下滑的担忧以及风险偏好下行，10年国债收益率快速下行至1.66%位置。随后因债市多空驱动相对均衡，10年国债收益率维持在1.66%-1.72%的区间震荡。

权益方面，从资本市场运行情况来看，上半年消费、机器人、TMT、创新药表现强势，这些板块要么符合当前政策发力方向，要么处于产业创新和升级的关键阶段，基于此，管理人在选股过程中会偏向上述产业方向，但在操作上管理人依旧持有审慎的态度，以公用事业等高股息资产打底，在上述投资板块中进行了仓位的调整。管理人坚持行业中性策略，主要判断未来行情走势以震荡向上为主，板块间或将出现快速轮动，如果贸然进行行业倾斜，或造成节奏改变导致持仓风险增加，因此运作过程中以稳为主兼顾收益平衡。

#### 4.4.2 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1.1929元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.70%，同期业绩比较基准收益率为3.72%；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1.1824元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.47%，同期业绩比较基准收益率为3.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

固收方面，虽然反内卷政策的推出及权益市场的走强对债券市场会产生阶段性冲击，但从基本面总基调来看，债市仍有较强的支撑空间。从季度时间周期来看，后续需观察货币政策和财政等政策的对冲力度及效果，以及复苏的持续情况。但考虑到年初十年期国债收益率低点在1.6%附近，隐含了较为悲观的关税与基本面预期以及较乐观的货币政策宽松预期（接近3次降息预期）。在当前政策利率较年初下调10BP、名义GDP的复苏态势的背景下，三季度十年期国债收益率趋势性下破1.5%的难度较大。从上行空间来看，考虑到货币政策维持“适度宽松”、地产、政信等社会整体融资需求较难出现趋势性反转，十年期国债高点阻力位预计在1.9%。

权益方面，管理人判断未来股市可能会进入震荡盘整，随后继续波段上涨，结构性行情降会不断上演，再次呈现板块间的快速轮动状态，因此在操作过程中并不追高，而是选择相对低位的个股进行布局，方向上重点围绕智能制造、智能驾驶等具有产业升级

逻辑和景气度较高的行业。核心点在于管理人坚定看好政府对于稳定资本市场和促进产业升级的决心和信心，因此配置上将更为积极，不断加大成长性板块的配置力度，在仓位上权益仍将维持高位运行，在维持净值稳定的基础上努力实现向上突破。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则—基本准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，成员由公司高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、监察稽核部门等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金管理人已按法规要求向中国证监会报送解决方案。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用

开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

| 资 产          | 附注号     | 本期末<br>2025年06月30日 | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|--------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资 产：         |         |                    |                     |
| 货币资金         | 6.4.7.1 | 11,718,319.52      | 614,660.45          |
| 结算备付金        |         | 36,189,240.13      | 4,468,545.79        |
| 存出保证金        |         | -                  | -                   |
| 交易性金融资产      | 6.4.7.2 | 21,195,400.52      | 1,991,635.59        |
| 其中：股票投资      |         | 21,195,400.52      | 1,991,635.59        |
| 基金投资         |         | -                  | -                   |
| 债券投资         |         | -                  | -                   |
| 资产支持证券<br>投资 |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资        |         | -                  | -                   |
| 其他投资         |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产       | 6.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产     | 6.4.7.4 | -                  | -                   |
| 应收清算款        |         | -                  | -                   |
| 应收股利         |         | 62,295.37          | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收申购款         |            | 1,880,873.13               | 297,749.20                  |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 71,046,128.67              | 7,372,591.03                |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2024年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>   |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | 357,854.26                 | 0.23                        |
| 应付赎回款         |            | 8,010.96                   | 144,773.39                  |
| 应付管理人报酬       |            | 47,123.44                  | 6,025.70                    |
| 应付托管费         |            | 4,712.33                   | 602.60                      |
| 应付销售服务费       |            | 7,559.45                   | 2,183.60                    |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | -                          | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 991.88                     | 6,500.00                    |
| 负债合计          |            | 426,252.32                 | 160,085.52                  |
| <b>净资产:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 59,401,981.17              | 6,732,223.66                |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 11,217,895.18              | 480,281.85                  |
| 净资产合计         |            | 70,619,876.35              | 7,212,505.51                |
| 负债和净资产总计      |            | 71,046,128.67              | 7,372,591.03                |

注：报告截止日2025年06月30日，格林鑫利六个月持有期混合A基金份额净值1.1929元，基金份额总额36,487,631.88份；格林鑫利六个月持有期混合C基金份额净值1.1824元，基金份额总额22,914,349.29份。格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金份额总额合计为59,401,981.17份。

6.2 利润表

会计主体：格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                       | 附注号      | 本期<br>2025年01月01日至<br>2025年06月30日 | 上年度可比期间<br>2024年01月01日至202<br>4年06月30日 |
|---------------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入                   |          | 2,702,800.75                      | 188,802.56                             |
| 1.利息收入                    |          | 17,884.32                         | 8,508.60                               |
| 其中：存款利息收入                 | 6.4.7.9  | 17,884.32                         | 8,508.60                               |
| 债券利息收入                    |          | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息<br>收入            |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产<br>收入            |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入                    |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”<br>填列）      |          | 746,118.92                        | 246,378.05                             |
| 其中：股票投资收益                 | 6.4.7.10 | 421,925.21                        | 85,230.04                              |
| 基金投资收益                    |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益                    | 6.4.7.11 | -                                 | 76,075.64                              |
| 资产支持证券投资<br>收益            | 6.4.7.12 | -                                 | -                                      |
| 贵金属投资收益                   |          | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益                    | 6.4.7.13 | -                                 | -                                      |
| 股利收益                      | 6.4.7.14 | 324,193.71                        | 85,072.37                              |
| 其他投资收益                    |          | -                                 | -                                      |
| 3.公允价值变动收益（损失<br>以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 1,938,797.51                      | -66,084.09                             |
| 4.汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）     |          | -                                 | -                                      |

|                     |            |              |            |
|---------------------|------------|--------------|------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）   | 6.4.7.16   | -            | -          |
| 减：二、营业总支出           |            | 197,725.64   | 126,161.80 |
| 1.管理人报酬             | 6.4.10.2.1 | 152,822.23   | 64,736.31  |
| 2.托管费               | 6.4.10.2.2 | 15,282.20    | 6,473.60   |
| 3.销售服务费             | 6.4.10.2.3 | 28,629.33    | 23,919.47  |
| 4.投资顾问费             |            | -            | -          |
| 5.利息支出              |            | -            | -          |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -            | -          |
| 6.信用减值损失            |            | -            | -          |
| 7.税金及附加             |            | -            | -          |
| 8.其他费用              | 6.4.7.17   | 991.88       | 31,032.42  |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 2,505,075.11 | 62,640.76  |
| 减：所得税费用             |            | -            | -          |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 2,505,075.11 | 62,640.76  |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -            | -          |
| 六、综合收益总额            |            | 2,505,075.11 | 62,640.76  |

6.3 净资产变动表

会计主体：格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金  
本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

| 项 目       | 本期                      |            |              |
|-----------|-------------------------|------------|--------------|
|           | 2025年01月01日至2025年06月30日 |            |              |
|           | 实收基金                    | 未分配利润      | 净资产合计        |
| 一、上期期末净资产 | 6,732,223.66            | 480,281.85 | 7,212,505.51 |
| 二、本期期初净资  | 6,732,223.66            | 480,281.85 | 7,212,505.51 |

|                                          |                         |               |               |
|------------------------------------------|-------------------------|---------------|---------------|
| 产                                        |                         |               |               |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 52,669,757.51           | 10,737,613.33 | 63,407,370.84 |
| （一）、综合收益总额                               | -                       | 2,505,075.11  | 2,505,075.11  |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | 52,669,757.51           | 8,232,538.22  | 60,902,295.73 |
| 其中：1.基金申购款                               | 54,757,039.45           | 8,505,601.26  | 63,262,640.71 |
| 2.基金赎回款                                  | -2,087,281.94           | -273,063.04   | -2,360,344.98 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                       | -             | -             |
| 四、本期期末净资产                                | 59,401,981.17           | 11,217,895.18 | 70,619,876.35 |
| 项 目                                      | 上年度可比期间                 |               |               |
|                                          | 2024年01月01日至2024年06月30日 |               |               |
|                                          | 实收基金                    | 未分配利润         | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产                                | 17,781,398.75           | 187,380.44    | 17,968,779.19 |
| 二、本期期初净资产                                | 17,781,398.75           | 187,380.44    | 17,968,779.19 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -9,098,154.54           | -91,239.25    | -9,189,393.79 |
| （一）、综合收益总额                               | -                       | 62,640.76     | 62,640.76     |

|                                          |               |             |               |
|------------------------------------------|---------------|-------------|---------------|
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -9,098,154.54 | -153,880.01 | -9,252,034.55 |
| 其中：1.基金申购款                               | 113,655.58    | 1,940.33    | 115,595.91    |
| 2.基金赎回款                                  | -9,211,810.12 | -155,820.34 | -9,367,630.46 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -             | -           | -             |
| 四、本期期末净资产                                | 8,683,244.21  | 96,141.19   | 8,779,385.40  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

高永红

马文杰

窦文静

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2022〕2492号文注册，由格林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集211,862,552.54元，业经上会会计师事务所(特殊普通合伙)上会师报字〔2023〕第1673号予以验证。经向中国证监会备案，《格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于2023年3月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为211,904,468.17份基金份额，其中包括认购资金利息折合的41,915.63份基金份额。本基金的基金管理人为格林基金管理有限公司，基金托管人为恒丰银行股份有限公司。

根据《格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别：A类基金份额和C类基金份额。在投资者认购/申购时收取认购/申购费的，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。A类、C类基金份额分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他依法发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、政策性金融债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、股指期货、国债期货、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资信用债券、可转换债券、可交换债券、资产支持证券。本基金的投资范围包括港股通标的股票，基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为10%-30%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%）。本基金投资于同业存单的比例占基金资产的0%-20%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：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%。

本财务报表由本基金的基金管理人格林基金管理有限公司于2025年8月29日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板

第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年1月1日至2025年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年1月1日至2025年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有

的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加

但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算确认。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们都必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金

额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1

年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2025年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 8,061,547.99       |
| 等于：本金        | 8,060,330.72       |
| 加：应计利息       | 1,217.27           |
| 减：坏账准备       | -                  |
| 定期存款         | -                  |
| 等于：本金        | -                  |
| 加：应计利息       | -                  |
| 减：坏账准备       | -                  |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                  |
| 存款期限1-3个月    | -                  |
| 存款期限3个月以上    | -                  |
| 其他存款         | 3,656,771.53       |

|        |               |
|--------|---------------|
| 等于：本金  | 3,656,730.98  |
| 加：应计利息 | 40.55         |
| 减：坏账准备 | -             |
| 合计     | 11,718,319.52 |

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2025年06月30日 |      |               |              |
|---------------|-------|--------------------|------|---------------|--------------|
|               |       | 成本                 | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 19,345,393.26      | -    | 21,195,400.52 | 1,850,007.26 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                  | -    | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | -                  | -    | -             | -            |
|               | 银行间市场 | -                  | -    | -             | -            |
|               | 合计    | -                  | -    | -             | -            |
| 资产支持证券        |       | -                  | -    | -             | -            |
| 基金            |       | -                  | -    | -             | -            |
| 其他            |       | -                  | -    | -             | -            |
| 合计            |       | 19,345,393.26      | -    | 21,195,400.52 | 1,850,007.26 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本报告期末，本基金无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | -                  |
| 应付交易费用      | -                  |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 991.88             |
| 合计          | 991.88             |

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 格林鑫利六个月持有期混合A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(格林鑫利六个月持有期混合A) | 本期<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |               |
|-----------------------|-------------------------------|---------------|
|                       | 基金份额（份）                       | 账面金额          |
| 上年度末                  | 948,937.80                    | 948,937.80    |
| 本期申购                  | 35,596,411.92                 | 35,596,411.92 |
| 本期赎回（以“-”号填列）         | -57,717.84                    | -57,717.84    |
| 本期末                   | 36,487,631.88                 | 36,487,631.88 |

6.4.7.7.2 格林鑫利六个月持有期混合C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(格林鑫利六个月持有期混合C) | 本期<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |              |
|-----------------------|-------------------------------|--------------|
|                       | 基金份额（份）                       | 账面金额         |
| 上年度末                  | 5,783,285.86                  | 5,783,285.86 |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 本期申购          | 19,160,627.53 | 19,160,627.53 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,029,564.10 | -2,029,564.10 |
| 本期末           | 22,914,349.29 | 22,914,349.29 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 格林鑫利六个月持有期混合A

单位：人民币元

| 项目<br>(格林鑫利六个月持有期混合A) | 已实现部分        | 未实现部分        | 未分配利润合计      |
|-----------------------|--------------|--------------|--------------|
| 上年度末                  | 17,943.25    | 55,698.68    | 73,641.93    |
| 本期期初                  | 17,943.25    | 55,698.68    | 73,641.93    |
| 本期利润                  | 293,154.94   | 1,070,655.16 | 1,363,810.10 |
| 本期基金份额交易产生的变动数        | 1,867,192.70 | 3,732,986.54 | 5,600,179.24 |
| 其中：基金申购款              | 1,870,380.94 | 3,738,160.95 | 5,608,541.89 |
| 基金赎回款                 | -3,188.24    | -5,174.41    | -8,362.65    |
| 本期已分配利润               | -            | -            | -            |
| 本期末                   | 2,178,290.89 | 4,859,340.38 | 7,037,631.27 |

6.4.7.8.2 格林鑫利六个月持有期混合C

单位：人民币元

| 项目<br>(格林鑫利六个月持有期混合C) | 已实现部分      | 未实现部分        | 未分配利润合计      |
|-----------------------|------------|--------------|--------------|
| 上年度末                  | 67,299.10  | 339,340.82   | 406,639.92   |
| 本期期初                  | 67,299.10  | 339,340.82   | 406,639.92   |
| 本期利润                  | 273,122.66 | 868,142.35   | 1,141,265.01 |
| 本期基金份额交易产生的变动数        | 801,704.86 | 1,830,654.12 | 2,632,358.98 |
| 其中：基金申购款              | 883,086.08 | 2,013,973.29 | 2,897,059.37 |

|         |              |              |              |
|---------|--------------|--------------|--------------|
| 基金赎回款   | -81,381.22   | -183,319.17  | -264,700.39  |
| 本期已分配利润 | -            | -            | -            |
| 本期末     | 1,142,126.62 | 3,038,137.29 | 4,180,263.91 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 6,849.11                      |
| 定期存款利息收入  | -                             |
| 其他存款利息收入  | 340.87                        |
| 结算备付金利息收入 | 10,694.34                     |
| 其他        | -                             |
| 合计        | 17,884.32                     |

注：本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 663,275.11                    |
| 减：卖出股票成本总额 | 222,915.29                    |
| 减：交易费用     | 18,434.61                     |
| 买卖股票差价收入   | 421,925.21                    |

6.4.7.11 债券投资收益

本报告期，本基金无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本报告期，本基金无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|-------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 324,193.71                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                             |
| 合计          | 324,193.71                    |

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 1,938,797.51                  |
| ——股票投资                 | 1,938,797.51                  |
| ——债券投资                 | -                             |
| ——资产支持证券投资             | -                             |
| ——基金投资                 | -                             |
| ——贵金属投资                | -                             |
| ——其他                   | -                             |
| 2.衍生工具                 | -                             |
| ——权证投资                 | -                             |
| 3.其他                   | -                             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                             |
| 合计                     | 1,938,797.51                  |

6.4.7.16 其他收入

本报告期，本基金无其他收入。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|-------|-------------------------------|
| 审计费用  | 991.88                        |
| 信息披露费 | -                             |
| 合计    | 991.88                        |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称      | 与本基金的关系               |
|------------|-----------------------|
| 格林基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 恒丰银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构          |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2025年01月01日至20<br>25年06月30日 | 上年度可比期间<br>2024年01月01日至20<br>24年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 152,822.23                        | 64,736.31                              |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 65,491.98                         | 32,015.92                              |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 87,330.25                         | 32,720.39                              |

注：1.支付基金管理人格林基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理费＝前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025年01月01日至2025<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2024年01月01日至2024<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 15,282.20                         | 6,473.60                               |

注：支付基金托管人恒丰银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期                      |                   |           |
|----------------------------|-------------------------|-------------------|-----------|
|                            | 2025年01月01日至2025年06月30日 |                   |           |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |                   |           |
|                            | 格林鑫利六个月持有期混合<br>A       | 格林鑫利六个月持有期混合<br>C | 合计        |
| 格林基金<br>管理有限公司             | 0.00                    | 0.00              | 0.00      |
| 恒丰银行<br>股份有限公司             | 0.00                    | 13,929.37         | 13,929.37 |
| 合计                         | 0.00                    | 13,929.37         | 13,929.37 |
| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 上年度可比期间                 |                   |           |
|                            | 2024年01月01日至2024年06月30日 |                   |           |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |                   |           |
|                            | 格林鑫利六个月持有期混合<br>A       | 格林鑫利六个月持有期混合<br>C | 合计        |
| 格林基金<br>管理有限公司             | 0.00                    | 0.00              | 0.00      |
| 恒丰银行<br>股份有限公司             | 0.00                    | 510.97            | 510.97    |
| 合计                         | 0.00                    | 510.97            | 510.97    |

注：1.本基金C类基金份额销售服务费年费率为0.40%，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日C类基金份额销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.40%/当年天数。

2.本基金A类基金份额不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期                      |          | 上年度可比期间                 |          |
|------------|-------------------------|----------|-------------------------|----------|
|            | 2025年01月01日至2025年06月30日 |          | 2024年01月01日至2024年06月30日 |          |
|            | 期末余额                    | 当期利息收入   | 期末余额                    | 当期利息收入   |
| 恒丰银行股份有限公司 | 8,061,547.99            | 6,849.11 | 133,265.43              | 1,098.96 |

注:本基金的活期银行存款由基金托管人恒丰银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金没有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间，无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本报告期内，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责审议公司风险管理工作的总体原则、方针和政策；审议公司的风险管理体系和风险管理制度；检查公司内部风险管理制度的执行情况，组织评价公司内控状况；组织检查及评价公司经营活动中的风险和相关控制措施的有效性；对公司重要创新业务及创新产品进行风险评估和风险决策；审议公司重大自由资产的配置和重大关联交易；检查公司财务状况及信息披露；听取基金业务负责人定期报告，评估公司合规管理和风险管理工作；定期向董事会报告公司经营活动中的风险管理状况；提议聘请或更换外部审计机构。在公司经理层下设风险管理委员会，主要负责组织、落实、商议公司风险管理工作，在经理层授权范围内协助经理层工作，出具相应的工作报告和专业意见，供经理层决策参考。在业务操作层面，公司监察稽核部为风险管理委员会的日常工作机构，根据风险管理委员会的要求，组织准备相关材料，做好相关工作，负责对公司基金运作、内部管理、系统实施和合法合规情况进行内部监督。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析相结合的风险管理方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本

基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行恒丰银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金无债券投资（上年度报告期末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期末，本基金所承担的所有金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025年0<br>6月30日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|------------------------|---------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                     |               |      |      |               |               |
| 货币资金                   | 11,718,319.52 | -    | -    | -             | 11,718,319.52 |
| 结算备付金                  | 36,189,240.13 | -    | -    | -             | 36,189,240.13 |
| 交易性金融资产                | -             | -    | -    | 21,195,400.52 | 21,195,400.52 |
| 应收股利                   | -             | -    | -    | 62,295.37     | 62,295.37     |
| 应收申购款                  | -             | -    | -    | 1,880,873.13  | 1,880,873.13  |
| 资产总计                   | 47,907,559.65 | -    | -    | 23,138,569.02 | 71,046,128.67 |
| 负债                     |               |      |      |               |               |
| 应付清算款                  | -             | -    | -    | 357,854.26    | 357,854.26    |
| 应付赎回款                  | -             | -    | -    | 8,010.96      | 8,010.96      |
| 应付管理人报酬                | -             | -    | -    | 47,123.44     | 47,123.44     |
| 应付托管费                  | -             | -    | -    | 4,712.33      | 4,712.33      |
| 应付销                    | -             | -    | -    | 7,559.45      | 7,559.45      |

|                             |               |      |      |               |               |
|-----------------------------|---------------|------|------|---------------|---------------|
| 售服务<br>费                    |               |      |      |               |               |
| 其他负<br>债                    | -             | -    | -    | 991.88        | 991.88        |
| 负债总<br>计                    | -             | -    | -    | 426,252.32    | 426,252.32    |
| 利率敏<br>感度缺<br>口             | 47,907,559.65 | -    | -    | 22,712,316.70 | 70,619,876.35 |
| 上年度<br>末<br>2024年1<br>2月31日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                          |               |      |      |               |               |
| 货币资<br>金                    | 614,660.45    | -    | -    | -             | 614,660.45    |
| 结算备<br>付金                   | 4,468,545.79  | -    | -    | -             | 4,468,545.79  |
| 交易性<br>金融资<br>产             | -             | -    | -    | 1,991,635.59  | 1,991,635.59  |
| 应收申<br>购款                   | -             | -    | -    | 297,749.20    | 297,749.20    |
| 资产总<br>计                    | 5,083,206.24  | -    | -    | 2,289,384.79  | 7,372,591.03  |
| 负债                          |               |      |      |               |               |
| 应付清<br>算款                   | -             | -    | -    | 0.23          | 0.23          |
| 应付赎<br>回款                   | -             | -    | -    | 144,773.39    | 144,773.39    |
| 应付管<br>理人报<br>酬             | -             | -    | -    | 6,025.70      | 6,025.70      |
| 应付托<br>管费                   | -             | -    | -    | 602.60        | 602.60        |
| 应付销                         | -             | -    | -    | 2,183.60      | 2,183.60      |

|         |              |   |   |              |              |
|---------|--------------|---|---|--------------|--------------|
| 售服务费    |              |   |   |              |              |
| 其他负债    | -            | - | - | 6,500.00     | 6,500.00     |
| 负债总计    | -            | - | - | 160,085.52   | 160,085.52   |
| 利率敏感度缺口 | 5,083,206.24 | - | - | 2,129,299.27 | 7,212,505.51 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资（上年度报告期末：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（上年度报告期末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产或负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2025年06月30日 |              |           |              |
|---------------|--------------------|--------------|-----------|--------------|
|               | 美元折合人民币            | 港币折合人民币      | 其他币种折合人民币 | 合计           |
| 以外币计价的资产      |                    |              |           |              |
| 交易性金融资产       | -                  | 9,791,524.00 | -         | 9,791,524.00 |
| 应收股利          | -                  | 62,295.37    | -         | 62,295.37    |
| 资产合计          | -                  | 9,853,819.37 | -         | 9,853,819.37 |
| 以外币计价的负债      |                    |              |           |              |
| 负债合计          | -                  | -            | -         | -            |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                  | 9,853,819.37 | -         | 9,853,819.37 |

| 项目            | 上年度末<br>2024年12月31日 |            |           |            |
|---------------|---------------------|------------|-----------|------------|
|               | 美元折合人民币             | 港币折合人民币    | 其他币种折合人民币 | 合计         |
| 以外币计价的资产      |                     |            |           |            |
| 交易性金融资产       | -                   | 993,308.91 | -         | 993,308.91 |
| 资产合计          | -                   | 993,308.91 | -         | 993,308.91 |
| 以外币计价的负债      |                     |            |           |            |
| 负债合计          | -                   | -          | -         | -          |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                   | 993,308.91 | -         | 993,308.91 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                                             |                                 |                     |
|----|---------------------------------------------|---------------------------------|---------------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低外汇风险而采取的风险管理活动 |                                 |                     |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                                             | 本期末<br>2025年06月30日              | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|    | 港币对人民币升值5%                                  | 492,690.97                      | 49,665.45           |
|    | 港币对人民币贬值5%                                  | -492,690.97                     | -49,665.45          |

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金的其他价格风险主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2025年06月30日 |     | 上年度末<br>2024年12月31日 |     |
|----|--------------------|-----|---------------------|-----|
|    | 公允价值               | 占基金 | 公允价值                | 占基金 |

|               |               | 资产净<br>值比例<br>(%) |              | 资产净<br>值比例<br>(%) |
|---------------|---------------|-------------------|--------------|-------------------|
| 交易性金融资产—股票投资  | 21,195,400.52 | 30.01             | 1,991,635.59 | 27.61             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -             | -                 | -            | -                 |
| 交易性金融资产—债券投资  | -             | -                 | -            | -                 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -             | -                 | -            | -                 |
| 衍生金融资产—权证投资   | -             | -                 | -            | -                 |
| 其他            | -             | -                 | -            | -                 |
| 合计            | 21,195,400.52 | 30.01             | 1,991,635.59 | 27.61             |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|----|----------------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动                  | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元) |                     |
|    |                            | 本期末<br>2025年06月30日          | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|    | 业绩比较基准上升5%                 | 1,114,640.32                | 116,548.26          |
|    | 业绩比较基准下降5%                 | -1,161,672.00               | -131,090.95         |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2025年06月30日 | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 21,195,400.52      | 1,991,635.59        |
| 第二层次          | -                  | -                   |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 21,195,400.52      | 1,991,635.59        |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 21,195,400.52 | 29.83        |
|    | 其中：股票             | 21,195,400.52 | 29.83        |
| 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      | 47,907,559.65 | 67.43        |
| 8  | 其他各项资产            | 1,943,168.50  | 2.74         |
| 9  | 合计                | 71,046,128.67 | 100.00       |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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              | 9,987,229.52 | 14.14        |
| 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      | 1,416,647.00 | 2.01         |
| 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              | 11,403,876.52 | 16.15 |

7.2.2 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 | 2,971,826.76 | 4.21         |
| 日常消费品    | -            | -            |
| 能源       | -            | -            |
| 金融       | 764,896.32   | 1.08         |
| 医疗保健     | 1,561,115.40 | 2.21         |
| 工业       | -            | -            |
| 信息技术     | -            | -            |
| 通讯业务     | -            | -            |
| 公用事业     | 4,493,685.52 | 6.36         |
| 地产       | -            | -            |
| 合计       | 9,791,524.00 | 13.87        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 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  | 02313  | 申洲国际   | 33,600  | 1,712,140.42 | 2.42         |
| 2  | 002841 | 视源股份   | 45,800  | 1,584,680.00 | 2.24         |
| 3  | 01083  | 港华智慧能源 | 439,000 | 1,579,525.51 | 2.24         |
| 4  | 01177  | 中国生物制药 | 325,000 | 1,561,115.40 | 2.21         |
| 5  | 02688  | 新奥能源   | 27,000  | 1,545,956.28 | 2.19         |
| 6  | 603508 | 思维列控   | 57,924  | 1,533,827.52 | 2.17         |
| 7  | 002271 | 东方雨虹   | 140,600 | 1,508,638.00 | 2.14         |
| 8  | 603565 | 中谷物流   | 148,340 | 1,416,647.00 | 2.01         |
| 9  | 688376 | 美埃科技   | 37,600  | 1,401,352.00 | 1.98         |
| 10 | 300777 | 中简科技   | 37,900  | 1,373,875.00 | 1.95         |
| 11 | 00384  | 中国燃气   | 204,400 | 1,368,203.73 | 1.94         |
| 12 | 605060 | 联德股份   | 64,800  | 1,349,784.00 | 1.91         |
| 13 | 00667  | 中国东方教育 | 206,500 | 1,259,686.34 | 1.78         |
| 14 | 301188 | 力诺药包   | 57,100  | 1,235,073.00 | 1.75         |
| 15 | 00388  | 香港交易所  | 2,000   | 764,896.32   | 1.08         |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 02313  | 申洲国际 | 1,661,710.05 | 23.04          |
| 2  | 002271 | 东方雨虹 | 1,653,577.00 | 22.93          |
| 3  | 002841 | 视源股份 | 1,509,957.00 | 20.94          |
| 4  | 02688  | 新奥能源 | 1,405,017.27 | 19.48          |

|    |        |        |              |       |
|----|--------|--------|--------------|-------|
| 5  | 603565 | 中谷物流   | 1,271,504.00 | 17.63 |
| 6  | 300777 | 中简科技   | 1,268,441.00 | 17.59 |
| 7  | 603508 | 思维列控   | 1,255,231.44 | 17.40 |
| 8  | 01083  | 港华智慧能源 | 1,236,035.81 | 17.14 |
| 9  | 605060 | 联德股份   | 1,197,923.00 | 16.61 |
| 10 | 688376 | 美埃科技   | 1,186,372.00 | 16.45 |
| 11 | 00384  | 中国燃气   | 1,090,239.50 | 15.12 |
| 12 | 01177  | 中国生物制药 | 1,078,908.96 | 14.96 |
| 13 | 301188 | 力诺药包   | 807,715.00   | 11.20 |
| 14 | 00388  | 香港交易所  | 476,475.75   | 6.61  |
| 15 | 00667  | 中国东方教育 | 388,774.93   | 5.39  |

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 本期累计卖出金额   | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|------------|----------------|
| 1  | 300718 | 长盛轴承   | 592,887.00 | 8.22           |
| 2  | 01177  | 中国生物制药 | 70,388.11  | 0.98           |

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 17,487,882.71 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 663,275.11    |

注;7.4.1项"买入金额"、7.4.2项"卖出金额"及.4.3项"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**7.8 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贵金属投资明细**  
本基金本报告期末未持有贵金属投资。

**7.9 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。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**  
本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 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。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中：**

美埃（中国）环境科技股份有限公司违反外汇登记管理规定，2025年2月8日被国家外汇管理局江苏省分局警告、罚款4万元，相关文号：苏汇检罚[2025]2号。

中谷物流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，2024年7月29日被中华人民共和国浦东海事局处以人民币3万元罚款，相关文号：海事罚字（2024）010700047412；因违反《中华人民共和国行政处罚法》第三十三条第一款，2024年8月1日被中华人民共和国吴淞海事局给予警告，相关文号：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。

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。

**7.12.2 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。**

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额 |
|----|-------|----|
| 1  | 存出保证金 | -  |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 2 | 应收清算款 | -            |
| 3 | 应收股利  | 62,295.37    |
| 4 | 应收利息  | -            |
| 5 | 应收申购款 | 1,880,873.13 |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 1,943,168.50 |

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级别                   | 持<br>有<br>人<br>户<br>数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构 |                |               |            |
|----------------------------|------------------------------|---------------|-------|----------------|---------------|------------|
|                            |                              |               | 机构投资者 |                | 个人投资者         |            |
|                            |                              |               | 持有份额  | 占总<br>份额<br>比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 格林<br>鑫利<br>六个<br>月持<br>有期 | 474                          | 76,978.13     | 0.00  | 0.00%          | 36,487,631.88 | 100.00%    |

|               |     |           |      |       |               |         |
|---------------|-----|-----------|------|-------|---------------|---------|
| 混合A           |     |           |      |       |               |         |
| 格林鑫利六个月持有期混合C | 517 | 44,321.76 | 0.00 | 0.00% | 22,914,349.29 | 100.00% |
| 合计            | 991 | 59,941.45 | 0.00 | 0.00% | 59,401,981.17 | 100.00% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别          | 持有份额总数<br>(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------------|---------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 格林鑫利六个月持有期混合A | 932.58        | 0.00%    |
|                  | 格林鑫利六个月持有期混合C | 17.98         | 0.00%    |
|                  | 合计            | 950.56        | 0.00%    |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别          | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|---------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 格林鑫利六个月持有期混合A | 0                 |
|                                | 格林鑫利六个月持有期混合C | 0                 |
|                                | 合计            | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 格林鑫利六个月持有期混合A | 0                 |
|                                | 格林鑫利六个月持有期混合C | 0                 |
|                                | 合计            | 0                 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 格林鑫利六个月持有期<br>混合A | 格林鑫利六个月持有期<br>混合C |
|----------------------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2023年03月20日)基金份额总额 | 37,373,095.46     | 174,531,372.71    |
| 本报告期期初基金份额总额               | 948,937.80        | 5,783,285.86      |
| 本报告期基金总申购份额                | 35,596,411.92     | 19,160,627.53     |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 57,717.84         | 2,029,564.10      |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                 | -                 |
| 本报告期期末基金份额总额               | 36,487,631.88     | 22,914,349.29     |

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。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

自2025年2月14日起，基金管理人独立董事由建兰宁、龙大伟、部慧变更为龙大伟、部慧、刘传葵；2025年5月31日，基金管理人督察长孙会离任，自2025年6月1日起由总经理高永红代任督察长职务。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施1                   | 内容                               |
|-----------------------|----------------------------------|
| 受到稽查或处罚等措施的主体         | 恒丰银行股份有限公司                       |
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2025年01月27日                      |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 中国人民银行                           |
| 受到的具体措施类型             | 警告、罚款                            |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 违反账户管理规定、违反反假币业务管理规定、占压财政存款或者资金等 |
| 托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | -                                |
| 其他                    | -                                |

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 华创证券 | 2      | 18,151,157.82 | 100.00%      | 8,566.34  | 100.00%    | -  |

注：1、报告期内未新增或退租证券公司交易单元。  
2、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基

金交易单元的选择标准如下：

- （1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的 需要；
- （3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行 业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分 析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报 告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的 服务和支持。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- （1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- （2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项        | 法定披露方式              | 法定披露日期     |
|----|-------------|---------------------|------------|
| 1  | 2024年第4季度报告 | 公司网站、资本市场电子化 信息披露平台 | 2025-01-22 |
| 2  | 2024年年度报告   | 公司网站、资本市场电子化 信息披露平台 | 2025-03-31 |
| 3  | 2025年第1季度报告 | 公司网站、资本市场电子化 信息披露平台 | 2025-04-22 |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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              | 20250211 - 2025 0522, 20250625 - 20250630 | 0.00 | 13,059,429.04 | 0.00 | 13,059,429.04 | 21.98% |

| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p><b>1、净值大幅波动的风险</b></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><b>2、出现巨额赎回的风险</b></p> <p>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。</p> |
| <p><b>3、基金规模过小的风险</b></p> <p>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。</p>                                                                 |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的住所。

12.3 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  
二〇二五年八月三十一日