

# 格林创新成长混合型证券投资基金

2023年第3季度报告

2023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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2023年10月25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合规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	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	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同约定，于2023年10月24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2023年7月1日起至2023年9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	格林创新成长混合	
基金主代码	007533	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年09月02日	
报告期末基金份额总额	11,913,154.02份	
投资目标	深入研究的基础上，在严格控制风险和保障必要流动性的前提下，力求实现基金资产的持续稳健增值。	
投资策略	本基金的投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、其他金融工具投资策略。在股票投资策略上，本基金力图对公司及行业所处的基本面进行深入分析和把握，自下而上地精选以创新为核心驱动力的行业及个股构建投资组合。	
业绩比较基准	中证800指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%	
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。	
基金管理人	格林基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	格林创新成长混合A	格林创新成长混合C

下属分级基金的交易代码	007533	007534
报告期末下属分级基金的份额总额	4,513,554.35份	7,399,599.67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(2023年07月01日 - 2023年09月30日)	
	格林创新成长混合A	格林创新成长混合C
1.本期已实现收益	-145,292.69	-277,739.45
2.本期利润	-408,038.63	-506,933.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0848	-0.0684
4.期末基金资产净值	2,955,039.17	4,675,156.54
5.期末基金份额净值	0.6547	0.6318

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

格林创新成长混合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	-11.09%	1.23%	-2.96%	0.61%	-8.13%	0.62%
过去六个月	-21.46%	1.28%	-6.23%	0.58%	-15.23%	0.70%
过去一年	-17.61%	1.43%	-1.27%	0.65%	-16.34%	0.78%
过去三年	-33.42%	1.44%	-10.25%	0.76%	-23.17%	0.68%
自基金合同生效起至今	-14.42%	1.39%	3.77%	0.82%	-18.19%	0.57%

格林创新成长混合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	-11.28%	1.23%	-2.96%	0.61%	-8.32%	0.62%
过去六个月	-21.78%	1.28%	-6.23%	0.58%	-15.55%	0.70%
过去一年	-18.27%	1.43%	-1.27%	0.65%	-17.00%	0.78%
过去三年	-34.97%	1.44%	-10.25%	0.76%	-24.72%	0.68%
自基金合同生效起至今	-17.14%	1.39%	3.77%	0.82%	-20.91%	0.57%

### 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

格林创新成长混合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

(2019年09月02日-2023年09月30日)



格林创新成长混合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  
(2019年09月02日-2023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		
王振林	本基金基金经理	2022-09-21	-	6年	王振林先生，中国人民大学金融专业硕士。曾任弘康人寿保险股份有限公司权益投资部股票研究员。2021年6月加入格林基金，任股票研究员，从事权益类资产的研究分析工作。2022年9月21日至今，担任格林创新成长混合型证券投资基金基金经理。
宋宾煌	本基金基金经理	2022-09-21	-	4年	宋宾煌先生，澳大利亚莫纳什大学电子与计算机系统专业博士。曾任中国银河证券股份有限公司通信行业

					研究员。2021年5月加入格林基金，任股票研究员，从事权益类资产的研究分析工作。2022年9月21日至今，担任格林创新成长混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期和离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

#### 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、《格林创新成长混合型证券投资基金基金合同》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

今年以来，新能源板块整体走势较差，主要因行业整体面临供需过剩的问题。锂电行业产能过剩凸显，整体盈利能力下降。光伏板块尽管需求旺盛，但过去三年的高景气



带来了大量的扩产，当前同样面临产能过剩的问题，未来产能出清还需要时间。而风电板块由于过去扩产不多，供需情况相对较好，因此风电板块的投资机会要好于光伏板块。短期海风受航道等政策影响，我们认为海风板块面临政策拐点，是基本面、估值和情绪的底部，当前投资机会明显。因此，第三季度我们主要配置在海风板块，标的集中在海缆和塔桩等环节。泛科技领域方面，第三季度板块回撤较大，主要因需求低迷导致半导体复苏态势低于预期，再叠加对华半导体限制政策更新传言和上半年AI主题热点钝化，导致博弈有所加剧。在操作中，我们短期规避业绩复苏不及预期的板块与个股，重点关注下游需求边际变化，努力把握情绪与业绩底部板块好转的拐点。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，格林创新成长混合A基金份额净值为0.6547元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.09%，同期业绩比较基准收益率为-2.96%；截至报告期末，格林创新成长混合C基金份额净值为0.6318元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.28%，同期业绩比较基准收益率为-2.96%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,140,947.90	86.47
	其中：股票	7,140,947.90	86.47
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	975,298.61	11.81



8	其他资产	141,947.69	1.72
9	合计	8,258,194.20	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	7,140,947.90	93.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,140,947.90	93.59

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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	603606	东方电缆	19,200	764,352.00	10.02
2	600522	中天科技	50,000	742,500.00	9.73
3	600487	亨通光电	52,200	737,064.00	9.66
4	301155	海力风电	12,400	735,444.00	9.64
5	300569	天能重工	100,600	727,338.00	9.53
6	002531	天顺风能	56,200	725,542.00	9.51
7	300129	泰胜风能	70,600	663,640.00	8.70
8	688349	三一重能	20,430	613,512.90	8.04
9	002080	中材科技	29,700	610,632.00	8.00
10	603985	恒润股份	19,300	527,469.00	6.91

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，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	6,517.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	135,430.25
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	141,947.69

### 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

	格林创新成长混合A	格林创新成长混合C
报告期期初基金份额总额	4,990,044.93	5,790,793.30
报告期期间基金总申购份额	426,608.74	8,635,101.73
减：报告期期间基金总赎回份额	903,099.32	7,026,295.36
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	4,513,554.35	7,399,599.67

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	20230828-20230926	0.00	4,045,962.13	4,045,962.13	0.00	0.00%
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。因此该投资者大额赎回时，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进行部分延期支付。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部分延期支付的风险。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>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，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，基金管理人可以按照《基金合同》约定的程序进行基金财产清算并直接终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。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>							

### 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创新成长混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《格林创新成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《格林创新成长混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《格林创新成长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

2023年10月25日