

# 格林创新成长混合型证券投资基金

## 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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

送出日期:2021 年 03 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本基金合同规定，于2021年3月30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2020年1月1日起至2020年12月31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	5
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	57
8.7 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	58
8.8 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	58
8.9 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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
8.12 投资组合报告附注.....	58
§9 基金份额持有人信息.....	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
9.3 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.....	60
§10 开放式基金份额变动.....	60
§11 重大事件揭示.....	61
11.1 基金份额持有人大会决议.....	61
11.2 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.....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
11.8 其他重大事件.....	63
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
12.1 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.....	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§13 备查文件目录.....	65
13.1 备查文件目录.....	65
13.2 存放地点.....	65
13.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	格林创新成长混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	53,877,505.78份	
基金合同存续期	不定期	
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	38,717,099.60份	15,160,406.18份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在深入研究的基础上，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	本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，合理确定基金在股票、债券、金融衍生品等各类资产类别上的投资比例。本基金将主要投资于权益类资产，并根据各类资产风险收益特征的相对变化和基金资产状况，适时动态调整股票类资产的投资比例，在控制风险的基础上提高基金的收益潜力。
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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙会
	联系电话	010-50890709
	电子邮箱	sunhui@china-greenfund.com
客户服务电话	4001000501	95588
传真	010-50890775	(010) 66105798
注册地址	北京市朝阳区东三环中路 5 号楼 47 层 04、05、06 号	北京市西城区复兴门内大街 5 号
办公地址	北京市朝阳区东三环中路 5 号楼财富金融中心 47 层（电梯层 58 层）04、05、06 号	北京市西城区复兴门内大街 5 号
邮政编码	100020	100140
法定代表人	高永红	陈四清

## 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
登载基金年度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>
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区东三环中路 5 号楼财富金融中心 47 层（电梯层 58 层）04、05、06 号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	格林基金管理有限公司	北京市朝阳区东三环中路 5 号楼财富金融中心 47 层（电梯层 58 层）04、05、06 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2020年		2019年09月02日（基金合同生效日） -2019年12月31日	
	格林创新成长混合A	格林创新成长混合C	格林创新成长混合A	格林创新成长混合C
本期已实现收益	5,676,646.05	1,169,386.04	485,995.44	86,219.04
本期利润	7,611,455.66	1,859,981.93	2,521,445.71	557,476.39
加权平均基金份额本期利润	0.2545	0.3111	0.0208	0.0078
本期加权平均净值利润率	23.65%	28.11%	2.08%	0.78%
本期基金份额净值增长率	49.65%	48.46%	2.15%	1.87%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	1,533,278.48	376,354.64	464,842.65	31,024.84
期末可供分配基金份额利润	0.0396	0.0248	0.0040	0.0013
期末基金资产净值	45,278,345.03	17,483,702.80	118,016,602.67	23,995,028.76
期末基金份额净值	1.1695	1.1532	1.0215	1.0187
3.1.3 累计期末指标	2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	52.87%	51.24%	2.15%	1.87%

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

格林创新成长混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	18.93%	1.01%	7.85%	0.71%	11.08%	0.30%
过去六个月	38.82%	1.29%	14.28%	0.94%	24.54%	0.35%
过去一年	49.65%	1.39%	18.07%	1.01%	31.58%	0.38%
自基金合同生效起至今	52.87%	1.20%	24.70%	0.91%	28.17%	0.29%

格林创新成长混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	18.69%	1.01%	7.85%	0.71%	10.84%	0.30%
过去六个月	38.27%	1.28%	14.28%	0.94%	23.99%	0.34%
过去一年	48.46%	1.39%	18.07%	1.01%	30.39%	0.38%
自基金合同生效起至今	51.24%	1.20%	24.70%	0.91%	26.54%	0.29%

#### 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



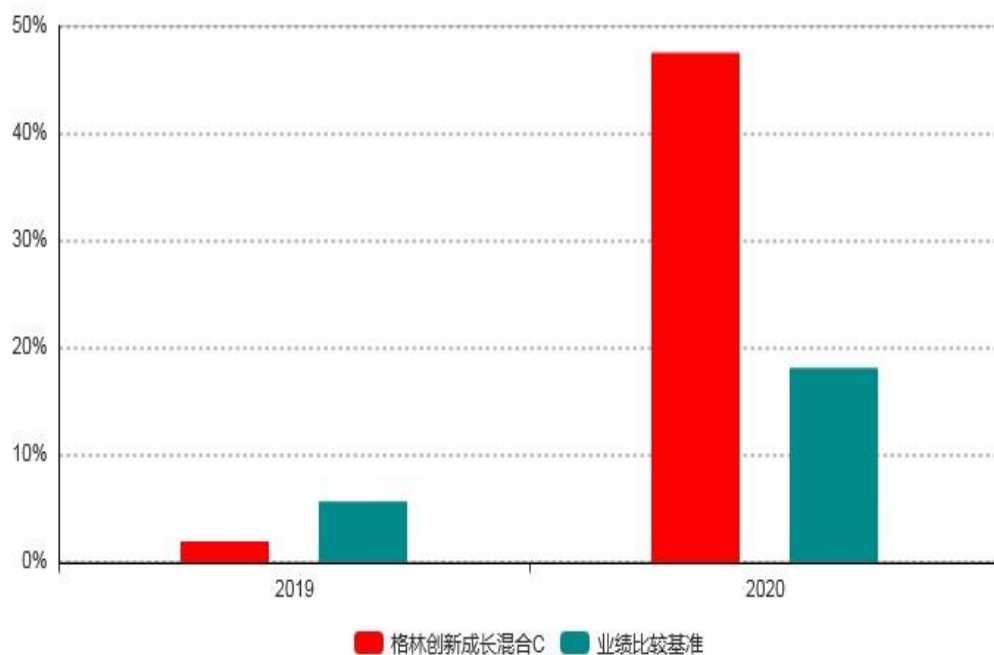
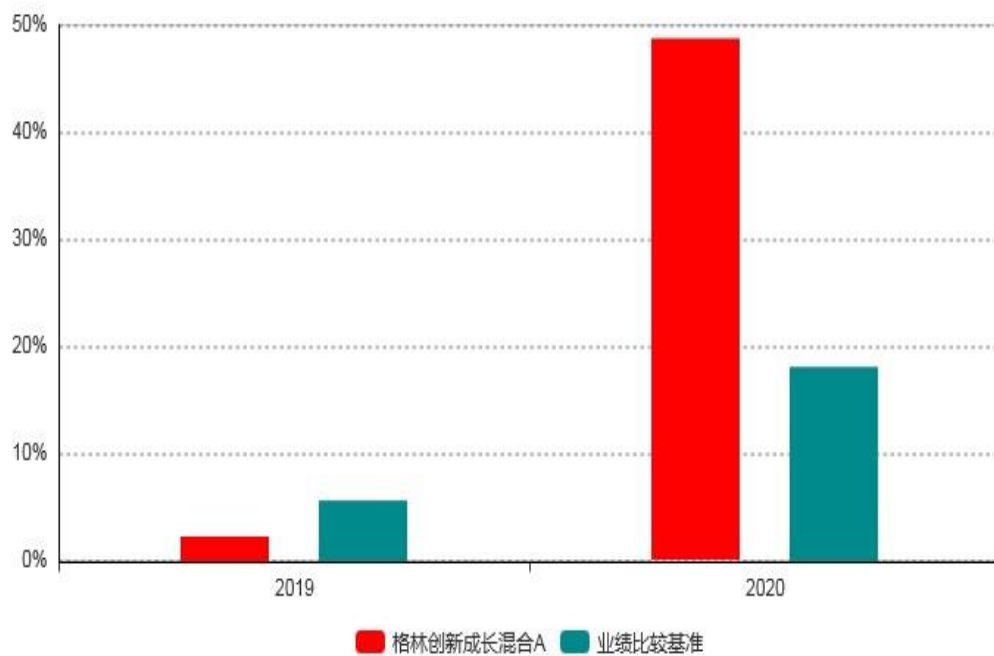
格林创新成长混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年09月02日-2020年12月31日)



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-2020年12月31日)



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

格林创新成长混合A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020年	3.500	10,523,755.15	2,299,024.71	12,822,779.86	-
合计	3.500	10,523,755.15	2,299,024.71	12,822,779.86	-

格林创新成长混合C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020年	3.500	5,168,929.56	95,496.94	5,264,426.50	-
合计	3.500	5,168,929.56	95,496.94	5,264,426.50	-

## § 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17700万元整，注册地为中国北京朝阳区。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2020年12月31日，格林基金管理有限公司共管理12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和格林泓安63个月定期开放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 证	说明
----	----	-------------	----

		金经理（助理） 期限		券 从 业 年 限	
		任职 日期	离任 日期		
宋绍峰	本基金基金经理、格林伯锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理、格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2019-09-02	-	12	宋绍峰先生，清华大学工学硕士，康奈尔大学约翰逊商学院MBA，持有CFA、FRM、CIIA等证书。曾先后在长城证券和泰达宏利基金从事投资研究工作，就读MBA期间曾在Cayuga Fund LLC和Luminus Management LLC从事研究工作。2017年加入格林基金，曾任专户投资经理，现任投资部基金经理。
李会忠	本基金基金经理、格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理、格林泓利增强债券型证券投资基金基金经理、格林稳健价值灵活配置混合型证券投资基金	2020-06-30	-	13	李会忠先生，清华大学经济学硕士。曾任新华基金管理股份有限公司金融工程部副总监、首席策略研究员、基金经理助理、基金经理，先后从事行业研究、投资决策等工作。2019年11月加入格林基金，任权益投资总监。

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4、本基金管理人于2020年9月26日发布公告，宋绍峰先生因个人原因无法正常履行职务，于2020年9月27日起休假，休假期间由基金经理李会忠先生单独履行基金经理职责。

#### 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》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《格林

创新成长混合型证券投资基金》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《格林基金管理有限公司公平交易管理办法》、《格林基金管理有限公司异常交易监控与报告办法》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2020年，上证综指上涨13.87%，沪深300上涨27.21%，创业板指上涨64.96%，结构性牛市行情明显，涨幅较大的行业有食品饮料、消费者服务、电力设备及新能源、国防军工、医药等，而下跌幅度明显的行业有通信、房地产、建筑、石油化工、银行、纺织服装等。2020年全年，本基金根据行业景气度情况、疫情影响、公司质地等因素，对一些表现突出的行业如食品饮料、医药等做了前瞻布局。

本基金将始终坚持价值投资理念，精选并长期持有能带来超额收益的优质公司，力争为基民创造良好的投资回报。

##### 4.4.2 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1.1695元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为49.65%，同期业绩比较基准收益率为18.07%；截至报告期末格林创新成长混合C基金份额净值为1.1532元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为48.46%，同期业绩比较基准收益率为18.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2021年，我们认为疫情后经济复苏将贯穿全年，经济增速前高后低，通胀压力可控。股市可能呈现震荡格局，预计收益率将明显小于2020年，结构性机会依然明显，但和2020年有明显的差别，之前涨幅较大、估值较贵的行业面临较长时间的调整压力，而像化工、有色、机械、建材等周期行业和银行、保险、房地产等大金融行业，很可能会迎来久违的上涨行情。我们将在优选个股的基础上，适度结合行业景气度拐点情况和估值情况，把配置重点向我们看好的这些行业倾斜，争取为基民带来稳健而可观的投资收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控内幕交易等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。报告期内，基金管理人的监察稽核体系运行顺利，本基金没有出现违法违规行为。

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 根据相关监管规定及公司规定，对基金发行前的基金文件进行合规性审查，确保相关基金文件的合法合规。

(2) 结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

(3) 日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强对重要业务和关键业务环节的监督检查。

(4) 规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，做好投资者教育和投资者适当性工作。

(5) 规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

(6) 以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大了对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。

公司自2016年成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。公司将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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》、《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验。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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，基金管理人于2020年12月28日发布《格林创新成长混

合型证券投资基金分红公告》，收益分配基准日为2020年12月22日，每10份A类和C类份额均分红3.5元，A类份额分配的总金额为12,822,779.86元，C类份额分配的总金额为5,264,426.50元。

#### 4.9 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

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 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

报告期内，本托管人严格遵守《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

报告期内，本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；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第22177号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------



审计报告收件人	格林创新成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了格林创新成长混合型证券投资基金(以下简称“格林创新成长混合基金”)的财务报表,包括2020年12月31日的资产负债表,2020年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了格林创新成长混合基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于格林创新成长混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	格林创新成长混合基金的基金管理人格林基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估格林创新

	<p>成长混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算格林创新成长混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督格林创新成长混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对格林创新成长混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非</p>

	无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致格林创新成长混合基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张勇	郭蕙心
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼	
审计报告日期	2021-03-26	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：格林创新成长混合型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,480,598.93	1,592,698.07
结算备付金		668,040.81	46,035,592.66
存出保证金		11,308.07	10,573.25
交易性金融资产	7.4.7.2	59,076,687.12	91,623,214.50
其中：股票投资		59,076,687.12	85,578,214.50
基金投资		-	-
债券投资		-	6,045,000.00
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	2,500,000.00
应收证券清算款		-	421.23
应收利息	7.4.7.5	607.89	778,657.95
应收股利		-	-
应收申购款		37,211.53	24,581.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		63,274,454.35	142,565,738.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		11,489.84	123,759.61
应付管理人报酬		91,236.14	188,707.82
应付托管费		15,206.03	31,451.31
应付销售服务费		13,282.44	20,477.61
应付交易费用	7.4.7.7	233,750.15	117,434.56
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	147,441.92	72,276.44
负债合计		512,406.52	554,107.35
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	53,877,505.78	139,092,397.31

未分配利润	7.4.7.10	8,884,542.05	2,919,234.12
所有者权益合计		62,762,047.83	142,011,631.43
负债和所有者权益总计		63,274,454.35	142,565,738.78

注：1、报告截止日2020年12月31日，格林创新成长混合A基金份额净值1.1695元，基金份额总额38,717,099.60份；格林创新成长混合C基金份额净值1.1532元，基金份额总额15,160,406.18份。格林创新成长混合型证券投资基金份额总额合计为53,877,505.78份。

2、比较财务报表的实际编制期间为2019年9月2日（基金合同生效日）至2019年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：格林创新成长混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生效日）至2019年12月31日
<b>一、收入</b>		10,609,831.61	4,643,156.74
1. 利息收入		68,779.76	1,648,694.69
其中：存款利息收入	7.4.7.11	23,244.15	1,344,387.93
债券利息收入		35,896.77	112,137.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,638.84	192,168.96
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,721,679.46	451,429.93
其中：股票投资收益	7.4.7.12	7,178,813.08	556,552.06
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	7,041.32	-105,122.13
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	535,825.06	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,625,405.50	2,506,707.62
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	193,966.89	36,324.50
<b>减：二、费用</b>		1,138,394.02	1,564,234.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	588,520.43	974,975.43
2. 托管费	7.4.10.2. 2	98,086.68	162,495.90
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	53,219.61	199,995.78
4. 交易费用	7.4.7.18	288,220.82	151,403.00
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	1.45
7. 其他费用	7.4.7.19	110,346.48	75,363.08
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		9,471,437.59	3,078,922.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		9,471,437.59	3,078,922.10

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：格林创新成长混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	139,092,397.31	2,919,234.12	142,011,631.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,471,437.59	9,471,437.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-85,214,891.53	14,581,076.70	-70,633,814.83
其中：1. 基金申购款	55,604,048.08	21,452,705.48	77,056,753.56
2. 基金赎回款	-140,818,939.61	-6,871,628.78	-147,690,568.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-18,087,206.36	-18,087,206.36
五、期末所有者权益(基金净值)	53,877,505.78	8,884,542.05	62,762,047.83
项 目	上年度可比期间 2019年09月02日(基金合同生效日)至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	287,884,594.01	-	287,884,594.01

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,078,922.10	3,078,922.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-148,792,196.70	-159,687.98	-148,951,884.68
其中：1. 基金申购款	1,157,941.84	1,242.97	1,159,184.81
2. 基金赎回款	-149,950,138.54	-160,930.95	-150,111,069.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	139,092,397.31	2,919,234.12	142,011,631.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

格林创新成长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[2019]953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《格林创新成长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287,817,682.00元,业经天健会计师事务所(特殊普通合伙)天健验[2019]1-125号予以验证。经向中国证监会备案,《格林创新成长混合型证券投资基金



基金合同》于2019年9月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为287,884,594.01份基金份额，其中认购资金利息折合66,912.01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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《格林创新成长混合型证券投资基金基金合同》和《格林创新成长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《格林创新成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款、资产支持证券、金融衍生品（含股指期货、国债期货、股票期权等）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）。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50%-95%，其中投资于本基金所界定的创新成长主题股票的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金参与股指期货、国债期货、股票期权交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关交易所的业务规则。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，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中证800指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×30%。

#### 7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定（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》、《格林创新成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年度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2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。比较财务报表的实际编制期间为2019年9月2日(基金合同生效日)至2019年12月31日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

#### 7.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易

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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。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认列。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。

#### 7.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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)。

#### 7.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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。

#### 7.4.4.10 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逐日确认。

其他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。

#### 7.4.4.11 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所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金不涉及外币交易。

#### 7.4.4.13 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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 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、资产支持证券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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、资产支持证券和私募债券除外),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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[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]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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应

税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(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。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	3,480,598.93	1,592,698.07
定期存款	-	-
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	-	-
合计	3,480,598.93	1,592,698.07

注：定期存款的存款期限指票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		53,944,574.00	59,076,687.12	5,132,113.12
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		53,944,574.00	59,076,687.12	5,132,113.12
项目		上年度末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		83,081,245.70	85,578,214.50	2,496,968.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	6,035,261.18	6,045,000.00	9,738.82
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,035,261.18	6,045,000.00	9,738.82
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		89,116,506.88	91,623,214.50	2,506,707.62

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。



## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,500,000.00	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	436.95	1,749.84
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	165.33	689,337.55
应收债券利息	-	87,775.89
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-210.61
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	5.61	5.28
合计	607.89	778,657.95

#### 7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	233,750.15	117,434.56
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	233,750.15	117,434.56

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	8.52	37.76
预提费用	147,433.40	72,238.68
合计	147,441.92	72,276.44

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 格林创新成长混合A

金额单位：人民币元

项目 (格林创新成长混合A)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	115,537,864.91	115,537,864.91
本期申购	38,022,198.83	38,022,198.83
本期赎回(以“-”号填列)	-114,842,964.14	-114,842,964.14
本期末	38,717,099.60	38,717,099.60

##### 7.4.7.9.2 格林创新成长混合C

金额单位：人民币元

项目 (格林创新成长混合C)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	23,554,532.40	23,554,532.40
本期申购	17,581,849.25	17,581,849.25
本期赎回(以“-”号填列)	-25,975,975.47	-25,975,975.47
本期末	15,160,406.18	15,160,406.18

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 格林创新成长混合A

单位：人民币元

项目 (格林创新成长混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	464,842.65	2,013,895.11	2,478,737.76
本期利润	5,676,646.05	1,934,809.61	7,611,455.66
本期基金份额交易产生的变动数	8,214,569.64	1,079,262.23	9,293,831.87
其中：基金申购款	12,391,915.90	2,498,084.75	14,890,000.65
基金赎回款	-4,177,346.26	-1,418,822.52	-5,596,168.78
本期已分配利润	-12,822,779.86	-	-12,822,779.86
本期末	1,533,278.48	5,027,966.95	6,561,245.43

##### 7.4.7.10.2 格林创新成长混合C

单位：人民币元

项目 (格林创新成长混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,024.84	409,471.52	440,496.36
本期利润	1,169,386.04	690,595.89	1,859,981.93
本期基金份额交易产生的变动数	4,440,370.26	846,874.57	5,287,244.83
其中：基金申购款	5,449,558.02	1,113,146.81	6,562,704.83
基金赎回款	-1,009,187.76	-266,272.24	-1,275,460.00

本期已分配利润	-5,264,426.50	-	-5,264,426.50
本期末	376,354.64	1,946,941.98	2,323,296.62

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年09月02日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	9,244.69	40,055.79
定期存款利息收入	-	161,104.17
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	13,666.92	1,143,207.44
其他	332.54	20.53
合计	23,244.15	1,344,387.93

注：2020年1月1日至2020年12月31日止期间，本基金未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	116,115,136.29	21,824,045.48
减：卖出股票成本总额	108,936,323.21	21,267,493.42
买卖股票差价收入	7,178,813.08	556,552.06

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2 020年12月31日	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
----	-----------------------------------	---

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	7,041.32	-105,122.13
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	7,041.32	-105,122.13

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生效日） 至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,881,543.59	26,048,890.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,739,671.18	25,943,396.33
减：应收利息总额	134,831.09	210,616.54
买卖债券差价收入	7,041.32	-105,122.13

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生效
----	--------------------	-------------------------------

	2020年12月31日	日) 至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	535,825.06	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	535,825.06	-

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至20 20年12月31日	上年度可比期间 2019年09月02日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	2,625,405.50	2,506,707.62
——股票投资	2,635,144.32	2,496,968.80
——债券投资	-9,738.82	9,738.82
——资产支持证券投资	-	-
——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	2,625,405.50	2,506,707.62

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年09月02日(基金合同生效 日) 至2019年12月31日
基金赎回费收入	193,966.69	36,324.50
转换费收入	0.20	-
合计	193,966.89	36,324.50

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	288,220.82	151,403.00
银行间市场交易费用	-	-
合计	288,220.82	151,403.00

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生效 日）至2019年12月31日
审计费用	45,000.00	30,000.00
信息披露费	60,194.72	42,238.68
汇划手续费	5,151.76	2,724.40
其他	-	400.00
合计	110,346.48	75,363.08

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

河南省安融房地产开发有限公司	基金管理人的股东
----------------	----------

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日 至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同 生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	588,520.43	974,975.43
其中：支付销售机构的客户维护费	368,792.30	651,597.19

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1.50%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×1.50%/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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日 至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生 效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	98,086.68	162,495.90

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	格林创新成长混合A	格林创新成长混合C	合计
格林基金 管理有限 公司	0.00	12,123.55	12,123.55
中国工商 银行股份 有限公司	0.00	34,631.20	34,631.20
合计	0.00	46,754.75	46,754.75
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生效日）至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	格林创新成长混合A	格林创新成长混合C	合计
格林基金 管理有限	0.00	40,563.86	40,563.86

公司			
中国工商银行股份有限公司	0.00	135,904.94	135,904.94
合计	0.00	176,468.80	176,468.80

注：（1）本基金C类基金份额销售服务费年费率为0.80%，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×0.80%/当年天数。

（2）本基金A类基金份额不收取销售服务费。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年09月02日（基金合同生效日） 至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,480,598.93	9,244.69	1,592,698.07	40,055.79

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

格林创新成长混合A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2020-1 2-29	2020-12- 29	3.500	10,523,7 55.15	2,299,024. 71	12,822,7 79.86	-
合计			3.500	10,523,7 55.15	2,299,024. 71	12,822,7 79.86	-

格林创新成长混合C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2020-1 2-29	2020-12- 29	3.500	5,168,92 9.56	95,496.94	5,264,42 6.50	-
合计			3.500	5,168,92 9.56	95,496.94	5,264,42 6.50	-

#### 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
6052 77	新亚 电子	2020 -12- 25	2021 -01- 06	新发 未上 市	16.9 5	16.9 5	507	8,59 3.65	8,59 3.65	-

003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新发未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新发未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份自发行结束之日起12个月内不得转让；所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起6个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%(根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，基金减持持有的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》的有关规定)；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

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 Related 控制措施的有效性；对公司重要创新业务及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、商榷公司风险管理工作，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。

#### 7.4.13.2 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中国工商银行，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。

本基金债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

于本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

于本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

于本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

于本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

于本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

于本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 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上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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金所承担的其他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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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期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股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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该比例限制)。

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7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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银行存款、结算备付金、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,480,598.93	-	-	-	3,480,598.93
结算备付金	668,040.81	-	-	-	668,040.81
存出保证金	11,308.07	-	-	-	11,308.07
交易性	-	-	-	59,076,687.12	59,076,687.12



金融资产					
应收利息	-	-	-	607.89	607.89
应收申购款	-	-	-	37,211.53	37,211.53
资产总计	4,159,947.81	-	-	59,114,506.54	63,274,454.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,489.84	11,489.84
应付管理人报酬	-	-	-	91,236.14	91,236.14
应付托管费	-	-	-	15,206.03	15,206.03
应付销售服务费	-	-	-	13,282.44	13,282.44
应付交易费用	-	-	-	233,750.15	233,750.15
其他负债	-	-	-	147,441.92	147,441.92
负债总计	-	-	-	512,406.52	512,406.52
利率敏感度缺口	4,159,947.81	-	-	58,602,100.02	62,762,047.83
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,592,698.07	-	-	-	1,592,698.07
结算备付金	46,035,592.66	-	-	-	46,035,592.66
存出保证金	10,573.25	-	-	-	10,573.25
交易性金融资产	6,045,000.00	-	-	85,578,214.50	91,623,214.50
买入返售金融资产	2,500,000.00	-	-	-	2,500,000.00

应收证券清算款	-	-	-	421.23	421.23
应收利息	-	-	-	778,657.95	778,657.95
应收申购款	-	-	-	24,581.12	24,581.12
资产总计	56,183,863.98	-	-	86,381,874.80	142,565,738.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	123,759.61	123,759.61
应付管理人报酬	-	-	-	188,707.82	188,707.82
应付托管费	-	-	-	31,451.31	31,451.31
应付销售服务费	-	-	-	20,477.61	20,477.61
应付交易费用	-	-	-	117,434.56	117,434.56
其他负债	-	-	-	72,276.44	72,276.44
负债总计	-	-	-	554,107.35	554,107.35
利率敏感度缺口	56,183,863.98	-	-	85,827,767.45	142,011,631.43

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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（上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为4.26%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	59,076,687.12	94.13	85,578,214.50	60.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	59,076,687.12	94.13	85,578,214.50	60.26

#### 7.4.13.4.3.2 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,875,790.58	0.00
	业绩比较基准下降5%	-2,808,895.91	0.00

注：上年度末，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 7.4.13.4.4 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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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中属于第一层次的余额为 59,054,897.58元，属于第二层次的余额为21,789.54元，无属于第三层次的余额（上年度末，属于第一层次的余额为85,571,636.46元，属于第二层次的余额为6,051,578.04元，无属于第三层次的余额）。

##### (ii) 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，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。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	59,076,687.12	93.37
	其中：股票	59,076,687.12	93.37
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	4,148,639.74	6.56
8	其他各项资产	49,127.49	0.08
9	合计	63,274,454.35	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	47,090,748.12	75.03
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	1,205,824.00	1.92
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	6,891,384.00	10.98
K	房地产业	2,726,696.00	4.34
L	租赁和商务服务业	581,343.00	0.93
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	580,692.00	0.93
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	59,076,687.12	94.13

### 8.3 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	600519	贵州茅台	2,600	5,194,800.00	8.28
2	601318	中国平安	57,300	4,983,954.00	7.94
3	000651	格力电器	79,700	4,936,618.00	7.87
4	000333	美的集团	39,200	3,858,848.00	6.15
5	000858	五粮液	11,300	3,297,905.00	5.25
6	600309	万华化学	35,900	3,268,336.00	5.21
7	600887	伊利股份	59,600	2,644,452.00	4.21
8	000895	双汇发展	53,200	2,497,208.00	3.98
9	603288	海天味业	12,220	2,450,598.80	3.90
10	000568	泸州老窖	9,600	2,171,136.00	3.46
11	600036	招商银行	43,400	1,907,430.00	3.04
12	000002	万科A	64,800	1,859,760.00	2.96

13	002304	洋河股份	6,600	1,557,534.00	2.48
14	600276	恒瑞医药	13,640	1,520,314.40	2.42
15	000538	云南白药	12,300	1,397,280.00	2.23
16	600660	福耀玻璃	28,700	1,379,035.00	2.20
17	000963	华东医药	45,400	1,205,824.00	1.92
18	000786	北新建材	29,500	1,181,475.00	1.88
19	002032	苏泊尔	13,900	1,084,061.00	1.73
20	600809	山西汾酒	2,700	1,013,283.00	1.61
21	603899	晨光文具	9,800	867,888.00	1.38
22	600048	保利地产	54,800	866,936.00	1.38
23	002677	浙江美大	47,700	759,861.00	1.21
24	002372	伟星新材	39,600	740,520.00	1.18
25	600690	海尔智家	24,478	715,002.38	1.14
26	600436	片仔癀	2,600	695,526.00	1.11
27	000921	海信家电	41,700	600,897.00	0.96
28	002508	老板电器	14,700	599,466.00	0.96
29	002027	分众传媒	58,900	581,343.00	0.93
30	600763	通策医疗	2,100	580,692.00	0.93
31	600104	上汽集团	20,100	491,244.00	0.78
32	002415	海康威视	8,700	422,037.00	0.67
33	002242	九阳股份	10,400	333,216.00	0.53
34	000661	长春高新	700	314,237.00	0.50
35	000423	东阿阿胶	6,600	255,486.00	0.41
36	600741	华域汽车	8,400	242,088.00	0.39
37	600585	海螺水泥	3,300	170,346.00	0.27
38	300192	科德教育	10,800	162,324.00	0.26
39	600031	三一重工	3,600	125,928.00	0.20
40	600761	安徽合力	7,700	109,340.00	0.17
41	605155	西大门	350	10,668.00	0.02
42	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
43	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01

44	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01
----	--------	------	-----	----------	------

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	000651	格力电器	7,624,654.55	5.37
2	601318	中国平安	7,171,476.00	5.05
3	600519	贵州茅台	6,777,165.98	4.77
4	000333	美的集团	5,211,157.18	3.67
5	000858	五粮液	3,938,093.40	2.77
6	600309	万华化学	3,911,270.16	2.75
7	000895	双汇发展	3,595,846.00	2.53
8	600887	伊利股份	3,251,845.00	2.29
9	603288	海天味业	2,973,924.40	2.09
10	000002	万科A	2,852,247.96	2.01
11	600036	招商银行	2,832,186.00	1.99
12	000568	泸州老窖	2,289,435.00	1.61
13	000963	华东医药	1,805,666.00	1.27
14	000538	云南白药	1,694,380.00	1.19
15	600660	福耀玻璃	1,653,952.66	1.16
16	000786	北新建材	1,618,625.00	1.14
17	600276	恒瑞医药	1,617,827.00	1.14
18	002304	洋河股份	1,613,455.00	1.14
19	002032	苏泊尔	1,465,870.91	1.03
20	600048	保利地产	1,414,957.00	1.00

##### 8.4.2 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	600519	贵州茅台	10,184,159.00	7.17
2	000651	格力电器	8,520,503.32	6.00
3	601318	中国平安	8,284,922.00	5.83
4	000333	美的集团	7,261,128.00	5.11
5	000895	双汇发展	5,526,752.00	3.89
6	000858	五粮液	5,415,779.00	3.81
7	603288	海天味业	5,240,905.88	3.69
8	600887	伊利股份	4,579,071.00	3.22
9	600309	万华化学	4,484,935.57	3.16
10	002415	海康威视	4,033,490.00	2.84
11	002027	分众传媒	3,742,366.00	2.64
12	000002	万科A	3,462,547.00	2.44
13	600036	招商银行	3,257,000.00	2.29
14	600660	福耀玻璃	2,802,770.00	1.97
15	000568	泸州老窖	2,719,715.00	1.92
16	600276	恒瑞医药	2,450,833.93	1.73
17	000538	云南白药	2,266,704.00	1.60
18	000786	北新建材	2,199,269.00	1.55
19	000963	华东医药	2,173,766.20	1.53
20	600048	保利地产	2,121,953.00	1.49

#### 8.4.3 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	79,834,051.51
卖出股票收入（成交）总额	116,115,136.29

注：8.4.1项“买入金额”、8.4.2项“卖出金额”及8.4.3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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的证券的发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	11,308.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	607.89
5	应收申购款	37,211.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	49,127.49
---	----	-----------

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
格林创新成长混合A	423	91,529.79	33,411,626.39	86.30%	5,305,473.21	13.70%
格林创新成长混合C	432	35,093.53	13,920,790.70	91.82%	1,239,615.48	8.18%
合计	855	63,014.63	47,332,417.09	87.85%	6,545,088.69	12.15%

#### 9.2 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(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	格林创新成长混合A	48,827.35	0.130%
	格林创新成长混合C	2,598.11	0.020%
	合计	51,425.46	0.100%

### 9.3 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	格林创新成长混合A	0~10
	格林创新成长混合C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	格林创新成长混合A	0
	格林创新成长混合C	0
	合计	0

### § 10 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
基金合同生效日(2019年09月02日)基金份额总额	125,389,858.29	162,494,735.72
本报告期期初基金份额总额	115,537,864.91	23,554,532.40
本报告期基金总申购份额	38,022,198.83	17,581,849.25
减：本报告期基金总赎回份额	114,842,964.14	25,975,975.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	38,717,099.60	15,160,406.18

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

2020年4月18日，基金管理人发布公告，解聘史彦刚先生担任公司副总经理。

2020年4月29日，基金管理人发布公告，增聘韩东霞女士担任公司副总经理。

2020年7月1日，基金管理人发布公告，增聘李会忠先生担任格林创新成长混合型证券投资基金基金经理。

2020年8月12日，基金管理人发布公告，解聘韩东霞女士担任公司副总经理。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用45,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	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	佣金	占当期佣金总量的	

	元数量		额的比例		比例	
渤海证券	2	60,034,077.02	30.75%	55,920.52	36.13%	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	135,183,227.64	69.25%	98,859.97	63.87%	-

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。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
渤海证券	5,991,180.90	84.97%	78,800,000.00	74.87%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-

万联证 券	1,059,941.60	15.03%	26,450,000.00	25.13%	-	-	-	-
----------	--------------	--------	---------------	--------	---	---	---	---

### 11.8 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	格林基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金2019年年度报告的公告	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-24
2	格林基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关业务的公告	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-04-18
3	格林基金管理有限公司关于暂停北京中天嘉华基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-28
4	关于格林创新成长混合型证券投资基金增聘基金经理的公告	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-01
5	格林创新成长混合型证券投资基金招募说明书更新（2020年第1号）	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-03
6	格林创新成长混合型证券投资基金招募说明书更新摘要（2020年第1号）	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-07-03
7	格林创新成长混合型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-08-31
8	格林创新成长混合型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-08-31
9	格林基金管理有限公司关于基金经理休假期间由他人代为履职的公告	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-09-26

10	格林创新成长混合型证券投资基金分红公告	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-12-28
11	关于格林创新成长混合型证券投资基金暂停大额申购(含定期定额申购)及转换转入业务的公告	《证券日报》、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-12-28

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20201124 - 20201126	-	7,126,216.63	-	7,126,216.63	13.23%
	2	20201120 - 20201126	-	5,480,268.57	-	5,480,268.57	10.17%
	3	20201126 - 20201231	-	20,805,141.19	-	20,805,141.19	38.62%
	4	20201203 - 20201231	-	13,920,790.70	-	13,920,790.70	25.84%
个人	1	20200702 - 20200706 - 20200824	2,988,181.14	0.00	2,988,181.14	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>1、净值大幅波动的风险 由于本基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该机构投资者大额赎回时，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 该机构投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。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 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。机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5,000万元情形。</p>							



本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

## 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 13.3 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  
二〇二一年三月三十一日