

格林泓安63个月定期开放债券型证券投资基金

2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人:格林基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26日

目录

§1 重要提示.....	3
§2 基金产品概况.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介.....	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	6
4.3 公平交易专项说明.....	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析.....	7
4.5 报告期内基金的业绩表现.....	7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	7
§5 投资组合报告.....	7
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.....	8
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.....	8
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	8
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.....	9
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.....	9
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.....	9
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.....	9
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	9
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	9
5.11 投资组合报告附注.....	10
§6 开放式基金份额变动.....	11
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况.....	11
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况.....	11
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细.....	11
§8 影响投资者决策的其他重要信息.....	11
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.....	11
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.....	12
9.3 查阅方式.....	12

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据基金合同约定，于2022年10月25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2022年7月1日起至2022年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	格林泓安63个月定开债
基金主代码	009738
交易代码	009738
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年11月02日
报告期末基金份额总额	5,700,719,605.15份
投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日（或回售日）不得晚于封闭期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。开放期内，本基金原则上将使基金资产保

	持现金状态。基金管理人将采取各类有效措施，保障基金运作安排，降低资产的流动性风险，满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日中国人民银行公布并执行的三年期定期存款基准利率（税后）+1.25%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型、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	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§ 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（2022年07月01日 - 2022年09月30日）
1. 本期已实现收益	64,891,992.08
2. 本期利润	64,891,992.08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0114
4. 期末基金资产净值	5,922,435,383.90
5. 期末基金份额净值	1.0389

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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以，公允价值变动损益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

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。

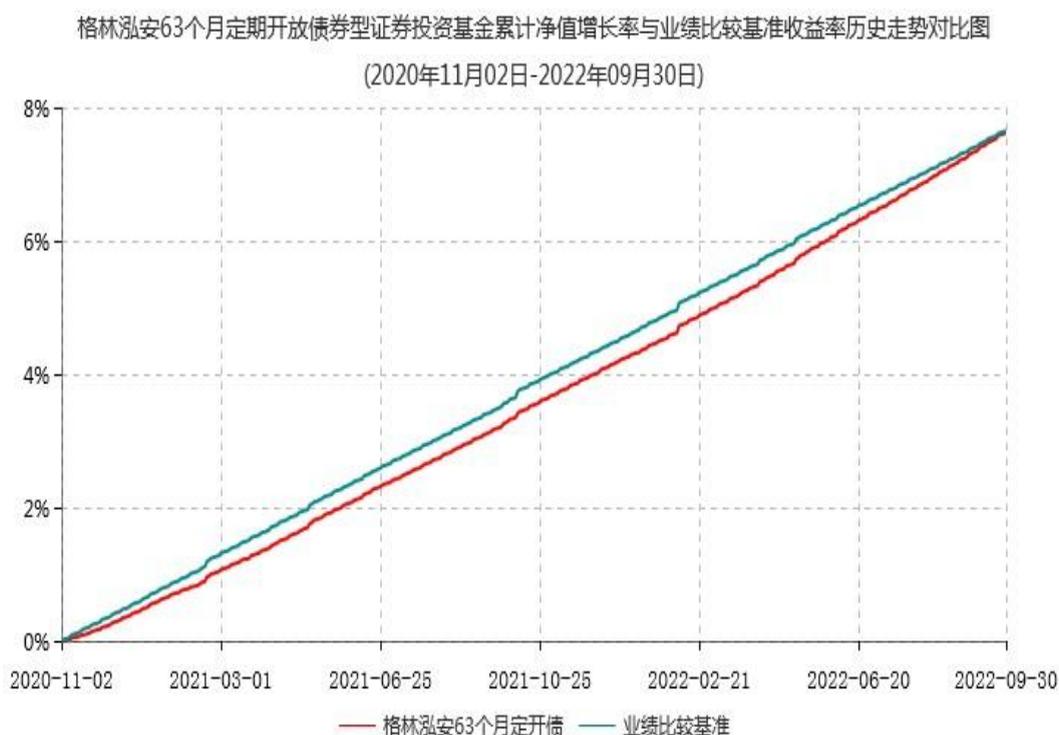
3.2 基金净值表现

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

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	1.11%	0.01%	0.95%	0.01%	0.16%	0.00%
过去六个月	2.18%	0.01%	1.90%	0.01%	0.28%	0.00%

过去一年	4.13%	0.01%	3.86%	0.01%	0.27%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.62%	0.01%	7.65%	0.01%	-0.03%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 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		
张晓圆	本基金基金经理	2020-11-02	-	9年	张晓圆女士，天津财经大学经济学硕士。曾任渤海证券固定收益总部承销项目经理、综合质控部副经理、交易一部副经理、投资交易部副经理，先后从

				<p>事债券承销、投资交易等工作。2018年5月加入格林基金，曾任专户投资经理，现任基金经理。2020年6月12日至2021年7月16日，担任格林日鑫月熠货币市场基金基金经理；2020年6月2日至2021年7月16日，担任格林泓泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2020年6月12日至2021年7月16日，担任格林泓裕一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2020年8月5日至2021年8月26日，担任格林泓利增强债券型证券投资基金基金经理；2018年12月3日至今，担任格林泓鑫纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年6月12日至今，担任格林泓远纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年11月2日至今，担任格林泓安63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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、本基金基金经理张晓圆女士因休产假于2022年8月4日起暂离工作岗位超过30天，无法正常履行基金经理相关职责。在张晓圆女士休假期间，本基金由杜钧天先生代为履行基金经理职责。上述事项已按相关规定进行披露并向中国证监会北京监管局备案。

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、《格林泓安63个月定期开放债券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

国外经济方面，三季度全球发达国家在高通胀和金融政策收紧背景下，经济下行压力加大。美国经济有一定韧性，通胀未见明显回落趋势，就业市场维持偏紧状态。国内经济方面，国内经济数据总体呈现修复状态，疫后生产修复明显快于需求，经济结构性分化持续，基建增速再创新高，出口增速开始下行，消费增速恢复较慢，地产维持负增长，经济总体处于弱复苏状态，PPI通胀回落，但CPI通胀震荡。本基金作为一只摊余成本法产品，在三季度继续享受了流动性宽松带来的利差增厚。

展望后市，本基金将继续控制融资成本，为投资者带来稳定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林泓安63个月定开债基金份额净值为1.0389元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.11%，同期业绩比较基准收益率为0.95%。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,338,005,820.84	99.83
	其中：债券	10,338,005,820.84	99.83
	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	17,609,759.05	0.17
8	其他资产	-	-
9	合计	10,355,615,579.89	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,393,443,490.43	124.84

	其中：政策性金融债	7,393,443,490.43	124.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	2,944,562,330.41	49.72
10	合计	10,338,005,820.84	174.56

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	200315	20进出15	20,000,000	2,066,190,723.84	34.89
2	180214	18国开14	15,000,000	1,588,374,531.43	26.82
3	200408	20农发08	14,600,000	1,461,975,813.68	24.69
4	160405	16农发05	13,350,000	1,363,553,289.84	23.02
5	180411	18农发11	7,700,000	810,509,022.05	13.69

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行2022年3月21日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会罚款440万元，相关文号：银保监罚决字（2022）8号。

中国进出口银行2022年3月21日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会罚款420万元，相关文号：银保监罚决字（2022）9号。

中国农业发展银行2022年3月21日因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会罚款480万元，相关文号：银保监罚决字（2022）10号。

除上述发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未发生被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金本报告期末持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	-

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	5,700,719,605.15
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	5,700,719,605.15

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
机构	1	20220701-20220930	2,000,269.00	-	-	2,000,269.00	35.09%
	2	20220701-20220930	2,000,449.00	-	-	2,000,449.00	35.09%
	3	20220701-20220930	1,699,999.00	-	-	1,699,999.00	29.82%
产品特有风险							
<p>1、净值大幅波动的风险</p> <p>由于本基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该机构投资者在开放日大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。</p> <p>2、出现巨额赎回的风险</p> <p>该机构投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回延缓支付赎回款项。其他投资者的</p>							

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。

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，在开放期最后一个开放日，出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金合同终止。该机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值低于5,000万元情形。

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泓安63个月定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《格林泓安63个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《格林泓安63个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《格林泓安63个月定期开放债券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

2022年10月26日