

# 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 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:兴业银行股份有限公司

送出日期:2023 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、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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月30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。

本报告期自2022年1月1日起至2022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                 | 6  |
| 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 净资产（基金净值）变动表                        | 23 |
| 7.4 报表附注                                | 25 |
| §8 投资组合报告                               | 56 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 56 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 57 |
| 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       | 57 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 59 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 61 |
| 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      | 61 |
| 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   | 61 |
| 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   | 61 |
| 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      | 61 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 61 |

|   |    |
|---|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 61 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                      | 61 |
| §9 基金份额持有人信息.....                       | 62 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 62 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 63 |
| 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.....   | 63 |
| §10 开放式基金份额变动.....                      | 63 |
| §11 重大事件揭示.....                         | 64 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 64 |
| 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.....   | 64 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 64 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 64 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 64 |
| 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.....      | 64 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 65 |
| 11.8 其他重大事件.....                        | 66 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 67 |
| 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..... | 67 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 67 |
| §13 备查文件目录.....                         | 67 |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 67 |
| 13.2 存放地点.....                          | 67 |
| 13.3 查阅方式.....                          | 68 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                   |               |
|-----------------|-------------------|---------------|
| 基金名称            | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金 |               |
| 基金简称            | 格林伯元灵活配置          |               |
| 基金主代码           | 004942            |               |
| 基金运作方式          | 契约型开放式            |               |
| 基金合同生效日         | 2018年02月06日       |               |
| 基金管理人           | 格林基金管理有限公司        |               |
| 基金托管人           | 兴业银行股份有限公司        |               |
| 报告期末基金份额总额      | 8,072,567.97份     |               |
| 基金合同存续期         | 不定期               |               |
| 下属分级基金的基金简称     | 格林伯元灵活配置A         | 格林伯元灵活配置C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 004942            | 004943        |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,343,810.09份     | 3,728,757.88份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在严格控制风险的前提下,通过灵活的资产配置、策略配置,追求基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金的主要投资策略包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、其他金融工具投资策略。在股票投资策略上,本基金采取“自上而下”与“自下而上”相结合的分析方法进行股票投资,并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×50%+沪深300指数收益率×50%。  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等预期收益产品。   |

### 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                                      | 兴业银行股份有限公司                 |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 孙会  | 李真                         |
|             | 联系电话 | 010-50890709                                    | 021-52629999-212051        |
|             | 电子邮箱 | sunhui@china-greenfund.com                      | tgb_lizhen@cib.com.cn      |
| 客户服务电话      |      | 4001000501                                      | 95561                      |
| 传真          |      | 010-50890775                                    | 021-62159217               |
| 注册地址        |      | 北京市朝阳区东三环中路 5 号楼 47 层 04、05、06 号                | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 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 | 上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼       |
| 邮政编码        |      | 100020  | 200120                     |
| 法定代表人       |      | 高永红   | 吕家进                        |

## 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） | 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 | 2022年        |               | 2021年        |                | 2020年         |                |
|---------------|--------------|---------------|--------------|----------------|---------------|----------------|
|               | 格林伯元灵活配置A    | 格林伯元灵活配置C     | 格林伯元灵活配置A    | 格林伯元灵活配置C      | 格林伯元灵活配置A     | 格林伯元灵活配置C      |
| 本期已实现收益       | 187,128.72   | 280,312.83    | 2,386,698.44 | 1,660,555.05   | 4,922,826.55  | 9,222,557.49   |
| 本期利润          | -618,672.87  | -1,032,712.58 | -612,580.73  | -20,091,467.94 | 3,310,983.08  | 31,958,405.05  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1756      | -0.2676       | -0.0980      | -0.2993        | 0.2163        | 0.6321         |
| 本期加权平均净值利润率   | -13.35%      | -20.37%       | -5.86%       | -18.08%        | 18.57%        | 45.27%         |
| 本期基金份额净值增长率   | -14.26%      | -14.39%       | -8.12%       | -8.29%         | 67.62%        | 67.32%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022年末       |               | 2021年末       |                | 2020年末        |                |
| 期末可供分配利润      | 1,465,595.75 | 1,217,830.30  | 1,888,945.83 | 2,374,740.25   | 5,074,749.89  | 36,916,755.78  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.3374       | 0.3266        | 0.5598       | 0.5495         | 0.3809        | 0.3741         |
| 期末基金资产净值      | 5,809,405.84 | 4,946,588.18  | 5,263,510.33 | 6,696,402.66   | 22,621,751.15 | 166,743,677.85 |
| 期末基金份额净值      | 1.3374       | 1.3266        | 1.5598       | 1.5495         | 1.6977        | 1.6896         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2022年末       |               | 2021年末       |                | 2020年末        |                |
| 基金份额累计净值增长率   | 33.74%       | 32.66%        | 55.98%       | 54.95%         | 69.77%        | 68.96%         |

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

##### 格林伯元灵活配置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      | 2.63%    | 1.90%       | 0.70%      | 0.64%         | 1.93%  | 1.26% |
| 过去六个月      | -9.23%   | 1.54%       | -6.85%     | 0.55%         | -2.38% | 0.99% |
| 过去一年       | -14.26%  | 1.62%       | -10.80%    | 0.64%         | -3.46% | 0.98% |
| 过去三年       | 32.05%   | 1.42%       | 0.03%      | 0.64%         | 32.02% | 0.78% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.74%   | 1.17%       | 1.89%      | 0.65%         | 31.85% | 0.52% |

##### 格林伯元灵活配置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      | 2.59%    | 1.90%       | 0.70%      | 0.64%         | 1.89%  | 1.26% |
| 过去六个月      | -9.30%   | 1.54%       | -6.85%     | 0.55%         | -2.45% | 0.99% |
| 过去一年       | -14.39%  | 1.62%       | -10.80%    | 0.64%         | -3.59% | 0.98% |
| 过去三年       | 31.37%   | 1.42%       | 0.03%      | 0.64%         | 31.34% | 0.78% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.66%   | 1.17%       | 1.89%      | 0.65%         | 30.77% | 0.52% |

#### 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



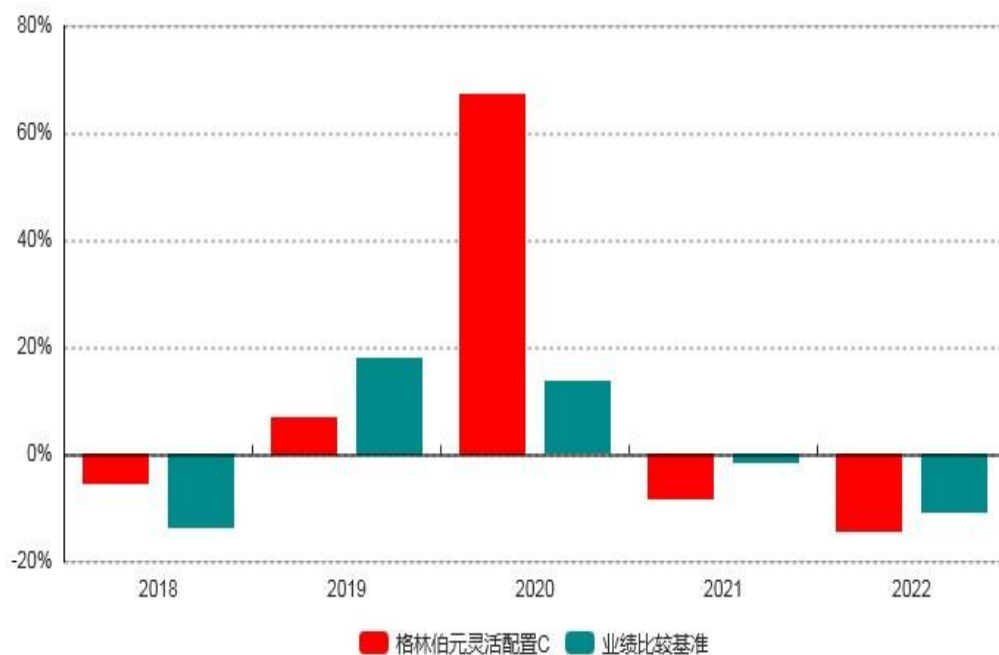
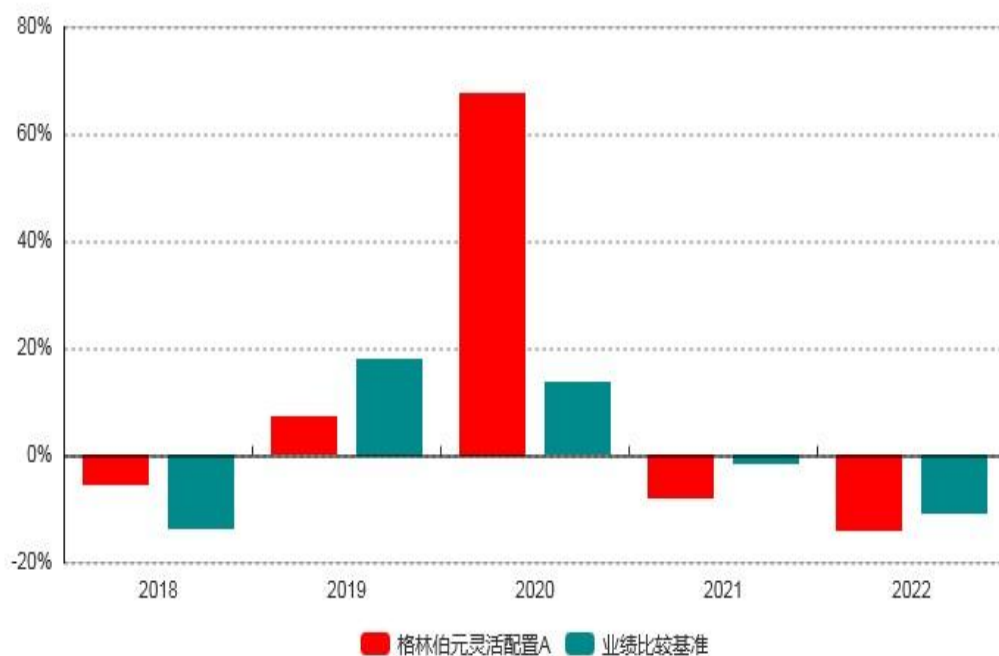
格林伯元灵活配置A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018年02月06日-2022年12月31日)



格林伯元灵活配置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  
(2018年02月06日-2022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

本基金过去三年无利润分配事项。

## §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东三环中路5号楼47层04、05、06号。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2022年12月31日，格林基金管理有限公司共管理23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、格林研究优选混合型证券投资基金、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、格林泓旭利率债债券型证券投资基金、格林泓丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、格林聚享增强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、格林泓盛一年定期开放债券型发起式证券投资基金、格林聚鑫增强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 |        |  |
| 李会忠 | 本基金基金经理、权益投资总监 | 2020-06-29      | -    | 16年    | 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 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>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，任权益投研总监、基金经理。2020年8月21日至2021年9月27日，担任格林泓利增强债券型证券投资基金基金经理；2021年2月22日至2022年4月14日，担任格林伯锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2020年6月29日至今，担任格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2020年6月30日至2022年9月21日，担任格林创新成长混合型证券投资基金基金经理；2020年10月21日至今，担任格林稳健价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2021年6月9日至今，担任格林鑫悦一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021年8月19日至今，担任格林研究优选混合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。

#### 4.2 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。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，未直接或通过与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

2022年，在疫情防控政策较为严格、美联储加息、房地产信用风险加剧、俄乌冲突僵持不下等因素冲击下，国内股市全年下跌幅度较大，直到第四季度末，随着疫情管控放松，市场才开始有了些许反弹，全年上证综指下跌15.13%，历史角度看属于走势很不理想的年份。全年相对表现比较好的行业有餐饮旅游、煤炭、交通运输、商业贸易、房地产、农林牧渔等，而表现较弱的行业主要有电子、国防军工、通信、计算机、钢铁、基础化工等。2022年，本基金根据行业景气度情况、疫情影响、公司质地、估值水平等因素，对一些表现突出的领域做了前瞻布局和动态调整。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林伯元灵活配置A基金份额净值为1.3374元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-14.26%，同期业绩比较基准收益率为-10.80%；截至报告期末格林伯元灵活配置C基金份额净值为1.3266元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-14.39%，同期业绩比较基准收益率为-10.80%。

#### 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2023年，我们认为着眼长期，很多行业的估值水平处于合理偏低状态，我们会逐步从中选取优质的公司进行长期布局。短期看，我们认为市场可能处于牛市酝酿期，这正是我们寻找好股票进行长期布局的良机。当前点位，我们长期看好消费、医药、高端制造、科技、新能源汽车、房地产、银行等板块里优质股票的投资机会。

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，力争为持有人创造良好的投资回报。

#### 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，对基金的各类法律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

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 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，资产托管人严格遵守《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《中华人民共和国证券投资基金法》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

本基金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(2023)第24286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 | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见    | (一)我们审计的内容 我们审计了格林伯元灵活     |



|                 |   |
|-----------------|---|
|                 | <p>配置混合型证券投资基金(以下简称"格林伯元灵活配置基金")的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 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,公允反映了格林伯元灵活配置基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>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,我们独立于格林伯元灵活配置基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>  |
| 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 | <p>格林伯元灵活配置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伯元灵活配置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伯元灵活配置</p>                                |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | 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伯元灵活配置基金的财务报告过程。   |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <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，就可能对格林伯元灵活配置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伯元灵活配置基金不能持续经营。(五) 评价财务报表的总</p> |

|           |  |     |
|-----------|--|-----|
|           | 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  | 魏益佳  | 郭蕙心 |
| 会计师事务所的地址 | 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    | 2023-03-27   |     |

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：格林伯元灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 889,359.53         | 1,143,853.85        |
| 结算备付金      |         | 95,749.45          | 27,110.44           |
| 存出保证金      |         | 1,052.39           | 35,676.74           |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 10,205,889.00      | 11,182,727.31       |
| 其中：股票投资    |         | 10,205,889.00      | 11,182,727.31       |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | -                  | -                   |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资      |         | -                  | -                   |
| 其他投资       |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产     | 7.4.7.3 | -                  | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 债权投资          |            | -                          | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                          | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | -                          | 3,472.77                    |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 6,107.65                   | 19,135.32                   |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                          | 95,901.74                   |
| 资产总计          |            | 11,198,158.02              | 12,507,878.17               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2021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     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | 6.99                       | 24,192.14                   |
| 应付赎回款         |            | 38,378.07                  | 30,281.80                   |
| 应付管理人报酬       |            | 5,453.11                   | 6,368.72                    |
| 应付托管费         |            | 908.83                     | 1,061.45                    |
| 应付销售服务费       |            | 625.20                     | 889.35                      |
| 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          | 7.4.7.6    | 396,791.80                 | 485,171.72                  |

|             |         |               |               |
|-------------|---------|---------------|---------------|
| 负债合计        |         | 442,164.00    | 547,965.18    |
| <b>净资产：</b> |         |               |               |
| 实收基金        | 7.4.7.7 | 8,072,567.97  | 7,696,226.91  |
| 其他综合收益      |         | -             | -             |
| 未分配利润       | 7.4.7.8 | 2,683,426.05  | 4,263,686.08  |
| 净资产合计       |         | 10,755,994.02 | 11,959,912.99 |
| 负债和净资产总计    |         | 11,198,158.02 | 12,507,878.17 |

注：报告截止日2022年12月31日，格林伯元灵活配置A基金份额净值1.3374元，基金份额总额4,343,810.09份；格林伯元灵活配置C基金份额净值1.3266元，基金份额总额3,728,757.88份。格林伯元灵活配置混合型证券投资基金份额总额合计为8,072,567.97份。

## 7.2 利润表

会计主体：格林伯元灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2022年01月01日至2<br>022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2<br>021年12月31日 |
|------------------|----------|-----------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | -1,492,004.43                     | -19,070,997.56                         |
| 1.利息收入           |          | 3,465.66                          | 34,351.93                              |
| 其中：存款利息收入        | 7.4.7.9  | 3,465.66                          | 34,351.93                              |
| 债券利息收入           |          | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息收<br>入   |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产收<br>入   |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入           |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 616,977.96                        | 5,532,775.79                           |
| 其中：股票投资收益        | 7.4.7.10 | 401,302.98                        | 2,073,962.92                           |
| 基金投资收益           |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益           | 7.4.7.11 | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券投资收        | 7.4.7.12 | -                                 | -                                      |

|                            |            |               |                |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| 益                          |            |               |                |
| 贵金属投资收益                    |            | -             | -              |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.13   | -             | -              |
| 股利收益                       | 7.4.7.14   | 215,674.98    | 3,458,812.87   |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -             | -              |
| 其他投资收益                     |            | -             | -              |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.15   | -2,118,827.00 | -24,751,302.16 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -             | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.16   | 6,378.95      | 113,176.88     |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 159,381.02    | 1,633,051.11   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 58,362.29     | 731,985.37     |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 9,727.01      | 121,997.56     |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 7,646.72      | 167,216.83     |
| 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                    | 7.4.7.17   | 83,645.00     | 611,851.35     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -1,651,385.45 | -20,704,048.67 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -1,651,385.45 | -20,704,048.67 |
| 五、其他综合收益的税后净额              |            | -             | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -1,651,385.45 | -20,704,048.67 |

**7.3 净资产（基金净值）变动表**

会计主体：格林伯元灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |        |               |               |
|-------------------------------------|-------------------------------|--------|---------------|---------------|
|                                     | 实收基金                          | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                     | 7,696,226.91                  | -      | 4,263,686.08  | 11,959,912.99 |
| 加：会计政策变更                            | -                             | -      | -             | -             |
| 前期差错更正                              | -                             | -      | -             | -             |
| 其他                                  | -                             | -      | -             | -             |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                     | 7,696,226.91                  | -      | 4,263,686.08  | 11,959,912.99 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | 376,341.06                    | -      | -1,580,260.03 | -1,203,918.97 |
| （一）、综合收益总额                          | -                             | -      | -1,651,385.45 | -1,651,385.45 |
| （二）、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) | 376,341.06                    | -      | 71,125.42     | 447,466.48    |
| 其中：1.基金申购款                          | 4,903,598.15                  | -      | 1,445,608.71  | 6,349,206.86  |
| 2.基金赎回款                             | -4,527,257.09                 | -      | -1,374,483.29 | -5,901,740.38 |

|  |                                    |        |                |                 |
|--|------------------------------------|--------|----------------|-----------------|
| （三）、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） | -                                  | -      | -              | -               |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                  | -      | -              | -               |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 8,072,567.97                       | -      | 2,683,426.05   | 10,755,994.02   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |        |                |                 |
|  | 实收基金                               | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 112,013,666.54                     | -      | 77,351,762.46  | 189,365,429.00  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                  | -      | -              | -               |
| 前期差错更正                                   | -                                  | -      | -              | -               |
| 其他                                       | -                                  | -      | -              | -               |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 112,013,666.54                     | -      | 77,351,762.46  | 189,365,429.00  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -104,317,439.63                    | -      | -73,088,076.38 | -177,405,516.01 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | -      | -20,704,048.67 | -20,704,048.67  |
| （二）、本期基金份额交易产                            | -104,317,439.63                    | -      | -52,384,027.71 | -156,701,467.34 |



|  |                 |   |                |                 |
|--|-----------------|---|----------------|-----------------|
| 生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)                   |                 |   |                |                 |
| 其中: 1.基金申购款                              | 31,558,526.18   | - | 21,842,505.99  | 53,401,032.17   |
| 2.基金赎回款                                  | -135,875,965.81 | - | -74,226,533.70 | -210,102,499.51 |
| (三)、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) | -               | - | -              | -               |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -               | - | -              | -               |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 7,696,226.91    | - | 4,263,686.08   | 11,959,912.99   |

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

格林伯元灵活配置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(2017)1132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《格林伯元灵活配置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252,572,653.13元,业经天健会计师事务所(特殊普通合伙)天健验(2018)1-6号予以验证。经向中国证监会备案,《格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

252,612,238.39份基金份额，其中认购资金利息折合39,585.26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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《格林伯元灵活配置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《格林伯元灵活配置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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、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、中小企业私募债等）、货币市场工具、债券回购、股指期货、国债期货、资产支持证券、同业存单、银行存款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。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产比例为基金资产的0%-95%。每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资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。本基金参与股指期货、国债期货交易，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期货交易所的业务规则。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中债综合指数收益率 $\times$ 50%+沪深300指数收益率 $\times$ 50%。

#### 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、《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》、《格林伯元灵活配置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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60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5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2022年12月31日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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2022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2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产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。

#### 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

##### 新金融工具准则

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或金融负债。

##### (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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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

#### 新金融工具准则

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

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。

#### 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)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

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。

##### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

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。

#### 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净资产转出。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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、债券投资和资产支持证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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号--套期会计》及《企业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于2022年1月1日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为1,143,853.85元、27,110.44元、35,676.74元、95,901.74元、3,472.77元和19,135.32元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为1,143,976.21元、122,872.11元、35,694.45元、0.00元、3,472.77元和19,135.32元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为11,182,727.31元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为11,182,727.31元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为24,192.14元、30,281.80元、6,368.72元、1,061.45元、889.35元、336,594.18元和1.24元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为24,192.14元、30,281.80元、6,368.72元、1,061.45元、889.35元、336,594.18元和1.24元。

i) 于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 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。

(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 | 上年度末 |
|----|-----|------|
|----|-----|------|

|              | 2022年12月31日 | 2021年12月31日  |
|--------------|-------------|--------------|
| 活期存款         | 889,359.53  | 1,143,853.85 |
| 等于：本金        | 889,264.82  | 1,143,853.85 |
| 加：应计利息       | 94.71       | -            |
| 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         | -           | -            |
| 等于：本金        | -           | -            |
| 加：应计利息       | -           | -            |
| 减：坏账准备       | -           | -            |
| 合计           | 889,359.53  | 1,143,853.85 |

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<br>2022年12月31日 |      |               |             |
|---------------|--------------------|------|---------------|-------------|
|               | 成本                 | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动      |
| 股票            | 10,604,905.87      | -    | 10,205,889.00 | -399,016.87 |
| 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            | 10,604,905.87       | -    | 10,205,889.00 | -399,016.87  |
| 项目            | 上年度末<br>2021年12月31日 |      |               |              |
|               | 成本                  | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | 9,462,917.18        | -    | 11,182,727.31 | 1,719,810.13 |
| 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            | 9,462,917.18        | -    | 11,182,727.31 | 1,719,810.13 |

#### 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

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

##### 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 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|----|--------------------|---------------------|
|    |                    |                     |

|       |   |           |
|-------|---|-----------|
| 应收利息  | - | 95,901.74 |
| 其他应收款 | - | -         |
| 待摊费用  | - | -         |
| 合计    | - | 95,901.74 |

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 0.75               | 1.24                |
| 应付交易费用      | 342,791.05         | 336,594.18          |
| 其中：交易所市场    | 342,791.05         | 336,594.18          |
| 银行间市场       | -                  | -                   |
| 应付利息        | -                  | -                   |
| 预提费用        | 54,000.00          | 148,576.30          |
| 合计          | 396,791.80         | 485,171.72          |

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 格林伯元灵活配置A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(格林伯元灵活配置A) | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |               |
|-------------------|-------------------------------|---------------|
|                   | 基金份额（份）                       | 账面金额          |
| 上年度末              | 3,374,564.50                  | 3,374,564.50  |
| 本期申购              | 2,710,576.17                  | 2,710,576.17  |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -1,741,330.58                 | -1,741,330.58 |
| 本期末               | 4,343,810.09                  | 4,343,810.09  |

##### 7.4.7.7.2 格林伯元灵活配置C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| (格林伯元灵活配置C)   | 2022年01月01日至2022年12月31日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|
|               | 基金份额(份)                 | 账面金额          |
| 上年度末          | 4,321,662.41            | 4,321,662.41  |
| 本期申购          | 2,193,021.98            | 2,193,021.98  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,785,926.51           | -2,785,926.51 |
| 本期末           | 3,728,757.88            | 3,728,757.88  |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 格林伯元灵活配置A

单位：人民币元

| 项目<br>(格林伯元灵活配置A) | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计      |
|-------------------|---------------|---------------|--------------|
| 本期期初              | 2,591,071.33  | -702,125.50   | 1,888,945.83 |
| 本期利润              | 187,128.72    | -805,801.59   | -618,672.87  |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | 838,091.31    | -642,768.52   | 195,322.79   |
| 其中：基金申购款          | 2,327,191.17  | -1,566,696.05 | 760,495.12   |
| 基金赎回款             | -1,489,099.86 | 923,927.53    | -565,172.33  |
| 本期已分配利润           | -             | -             | -            |
| 本期末               | 3,616,291.36  | -2,150,695.61 | 1,465,595.75 |

##### 7.4.7.8.2 格林伯元灵活配置C

单位：人民币元

| 项目<br>(格林伯元灵活配置C) | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|-------------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初              | 3,266,813.43  | -892,073.18   | 2,374,740.25  |
| 本期利润              | 280,312.83    | -1,313,025.41 | -1,032,712.58 |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | -496,105.43   | 371,908.06    | -124,197.37   |
| 其中：基金申购款          | 1,852,184.63  | -1,167,071.04 | 685,113.59    |
| 基金赎回款             | -2,348,290.06 | 1,538,979.10  | -809,310.96   |



|         |              |               |              |
|---------|--------------|---------------|--------------|
| 本期已分配利润 | -            | -             | -            |
| 本期末     | 3,051,020.83 | -1,833,190.53 | 1,217,830.30 |

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 3,206.06                          | 33,061.74                              |
| 定期存款利息收入  | -                                 | -                                      |
| 其他存款利息收入  | -                                 | -                                      |
| 结算备付金利息收入 | 71.45                             | 798.48                                 |
| 其他        | 188.15                            | 491.71                                 |
| 合计        | 3,465.66                          | 34,351.93                              |

注：本基金本报告期内及上年度可比期间，未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

#### 7.4.7.10 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>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|------------|-----------------------------------|--|
| 卖出股票成交总额   | 3,871,958.67                      | 212,721,211.31                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,459,893.31                      | 210,647,248.39                         |
| 减：交易费用     | 10,762.38                         | -                                      |
| 买卖股票差价收入   | 401,302.98                        | 2,073,962.92                           |

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-买卖债券差价收入。

**7.4.7.12 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。

**7.4.7.13 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。

**7.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|-------------|-----------------------------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 215,674.98                        | 3,458,812.87                           |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                 | -                                      |
| 合计          | 215,674.98                        | 3,458,812.87                           |

**7.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2022年01月01日至2022年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12<br>月31日 |
|------------------------|-----------------------------------|--|
| 1.交易性金融资产              | -2,118,827.00                     | -24,751,302.16                         |
| ——股票投资                 | -2,118,827.00                     | -24,751,302.16                         |
| ——债券投资                 | -                                 | -                                      |
| ——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 | -2,118,827.00 | -24,751,302.16 |
|----|---------------|----------------|

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|--|
| 基金赎回费收入 | 6,378.95                          | 113,169.41                             |
| 转换费收入   | -                                 | 7.47                                   |
| 合计      | 6,378.95                          | 113,176.88                             |

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。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|-------|-----------------------------------|--|
| 审计费用  | 45,000.00                         | 45,000.00                              |
| 信息披露费 | -                                 | 94,576.30                              |
| 汇划手续费 | 1,445.00                          | 3,421.68                               |
| 账户维护费 | 36,000.00                         | 36,000.00                              |
| 其他    | 1,200.00                          | 1,200.00                               |
| 交易费用  | -                                 | 431,653.37                             |
| 合计    | 83,645.00                         | 611,851.35                             |

### 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 |
| 兴业银行股份有限公司     | 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<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 58,362.29                     | 731,985.37                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 21,017.20                     | 48,212.60                          |

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0.60%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×0.60%/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<br>2022年01月01日至2022<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021<br>年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 9,727.01                          | 121,997.56                             |

注：支付基金托管人兴业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。

#### 7.4.10.2.3 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<br>2022年01月01日至2022年12月31日      |            |            |
|----------------------------|------------------------------------|------------|------------|
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |            |            |
|                            | 格林伯元灵活配置A                          | 格林伯元灵活配置C  | 合计         |
| 格林基金<br>管理有限<br>公司         | 0.00                               | 506.79     | 506.79     |
| 兴业银行<br>股份有限<br>公司         | 0.00                               | 104.74     | 104.74     |
| 合计                         | -                                  | 611.53     | 611.53     |
| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |            |            |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |            |            |
|                            | 格林伯元灵活配置A                          | 格林伯元灵活配置C  | 合计         |
| 格林基金                       | 0.00                               | 150,818.97 | 150,818.97 |

|                    |      |            |            |
|--------------------|------|------------|------------|
| 管理有限<br>公司         |      |            |            |
| 兴业银行<br>股份有限<br>公司 | 0.00 | 182.77     | 182.77     |
| 合计                 | -    | 151,001.74 | 151,001.74 |

注：（1）本基金C类基金份额销售服务费年费率为0.15%，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×0.15%/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<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |          | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021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    |
| 兴业银行<br>股份有限<br>公司 | 889,359.53                    | 3,206.06 | 1,143,853.85                       | 33,061.74 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业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

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。

#### 7.4.11 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。

#### 7.4.12 期末（2022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

本报告期末，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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严格控制风险的前提下，通过灵活的资产配置、策略配置，追求基金资产的长期稳健增值。

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 risk 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。

#### 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兴业银行股份有限公司，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：无）。

#### 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，本基金所承担的全部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。

#### 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银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年1<br>2月31<br>日 | 1年以内       | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|----------------------------|------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                         |            |      |      |               |               |
| 银行存款                       | 889,359.53 | -    | -    | -             | 889,359.53    |
| 结算备付金                      | 95,749.45  | -    | -    | -             | 95,749.45     |
| 存出保证金                      | 1,052.39   | -    | -    | -             | 1,052.39      |
| 交易性金融资产                    | -          | -    | -    | 10,205,889.00 | 10,205,889.00 |
| 应收申购款                      | -          | -    | -    | 6,107.65      | 6,107.65      |
| 资产总计                       | 986,161.37 | -    | -    | 10,211,996.65 | 11,198,158.02 |
| 负债                         |            |      |      |               |               |
| 应付清算款                      | -          | -    | -    | 6.99          | 6.99          |

|                     |              |      |      |               |               |
|---------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 应付赎回款               | -            | -    | -    | 38,378.07     | 38,378.07     |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -    | 5,453.11      | 5,453.11      |
| 应付托管费               | -            | -    | -    | 908.83        | 908.83        |
| 应付销售服务费             | -            | -    | -    | 625.20        | 625.20        |
| 其他负债                | -            | -    | -    | 396,791.80    | 396,791.80    |
| 负债总计                | -            | -    | -    | 442,164.00    | 442,164.00    |
| 利率敏感度缺口             | 986,161.37   | -    | -    | 9,769,832.65  | 10,755,994.02 |
| 上年度末<br>2021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                | 1,143,853.85 | -    | -    | -             | 1,143,853.85  |
| 结算备付金               | 27,110.44    | -    | -    | -             | 27,110.44     |
| 存出保证金               | 35,676.74    | -    | -    | -             | 35,676.74     |
| 交易性金融资产             | -            | -    | -    | 11,182,727.31 | 11,182,727.31 |
| 应收清算款               | -            | -    | -    | 3,472.77      | 3,472.77      |
| 应收申购款               | -            | -    | -    | 19,135.32     | 19,135.32     |
| 其他资产                | -            | -    | -    | 95,901.74     | 95,901.74     |
| 资产总计                | 1,206,641.03 | -    | -    | 11,301,237.14 | 12,507,878.17 |
| 负债                  |              |      |      |               |               |
| 应付清算款               | -            | -    | -    | 24,192.14     | 24,192.14     |
| 应付赎回款               | -            | -    | -    | 30,281.80     | 30,281.80     |

|         |              |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 应付管理人报酬 | -            | - | - | 6,368.72      | 6,368.72      |
| 应付托管费   | -            | - | - | 1,061.45      | 1,061.45      |
| 应付销售服务费 | -            | - | - | 889.35        | 889.35        |
| 其他负债    | -            | - | - | 485,171.72    | 485,171.72    |
| 负债总计    | -            | - | - | 547,965.18    | 547,965.18    |
| 利率敏感度缺口 | 1,206,641.03 | - | - | 10,753,271.96 | 11,959,912.99 |

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（上年度报告期末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度报告期末：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<br>2022年12月31日 |            | 上年度末<br>2021年12月31日 |            |
|----|--------------------|------------|---------------------|------------|
|    | 公允价值               | 占基金<br>资产净 | 公允价值                | 占基金<br>资产净 |
|    |                    |            |                     |            |

|               |               | 值比例<br>(%) |               | 值比例<br>(%) |
|---------------|---------------|------------|---------------|------------|
| 交易性金融资产—股票投资  | 10,205,889.00 | 94.89      | 11,182,727.31 | 93.50      |
| 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            | 10,205,889.00 | 94.89      | 11,182,727.31 | 93.50      |

#### 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<br>2022年12月31日          | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|    | 业绩比较基准上升5%                 | 583,477.91                  | 636,008.30          |
|    | 业绩比较基准下降5%                 | -646,206.60                 | -701,898.52         |

#### 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 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 10,205,889.00      | 9,899,478.00        |
| 第二层次          | -                  | -                   |
| 第三层次          | -                  | 1,283,249.31        |
| 合计            | 10,205,889.00      | 11,182,727.31       |

##### 7.4.14.2.2 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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |              |              |
|---------|-------------------------------|--------------|--------------|
|         | 交易性金融资产                       |              | 合计           |
|         | 债券投资                          | 股票投资         |              |
| 期初余额    | -                             | 1,283,249.31 | 1,283,249.31 |
| 当期购买    | -                             | -            | -            |
| 当期出售/结算 | -                             | -            | -            |
| 转入第三层次  | -                             | -            | -            |

|  |                                    |              |              |
|--|------------------------------------|--------------|--------------|
| 转出第三层次                                     | -                                  | 1,228,831.72 | 1,228,831.72 |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                  | -54,417.59   | -54,417.59   |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                  | -54,417.59   | -54,417.59   |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                  | -            | -            |
| 期末余额                                       | -                                  | -            | -            |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                  | -            | -            |
| 项目   | 上年度可比同期<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |              |              |
|  | 交易性金融资产                            |              | 合计           |
|  | 债券投资                               | 股票投资         |              |
| 期初余额                                       | -                                  | -            | -            |
| 当期购买                                       | -                                  | 331,934.91   | 331,934.91   |
| 当期出售/结算                                    | -                                  | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -                                  | -            | -            |
| 转出第三层次                                     | -                                  | -            | -            |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                  | 951,314.40   | 951,314.40   |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                  | 951,314.40   | 951,314.40   |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                  | -            | -            |
| 期末余额                                       | -                                  | 1,283,249.31 | 1,283,249.31 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                  | 951,314.40   | 951,314.40   |

于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

于上年度末，上述第三层次金融资产采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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或金融负债(上年度末：无)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## §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     | 10,205,889.00 | 91.14        |
|    | 其中：股票    | 10,205,889.00 | 91.14        |
| 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      | 985,108.98    | 8.80   |
| 8 | 其他各项资产            | 7,160.04      | 0.06   |
| 9 | 合计                | 11,198,158.02 | 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              | 9,514,253.00  | 88.46        |
| 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           | 65,520.00     | 0.61         |
| 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              | 410,240.00    | 3.81         |
| K  | 房地产业             | 131,040.00    | 1.22         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 84,836.00     | 0.79         |
| 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               | 10,205,889.00 | 94.89        |

## 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<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|----------------------|
| 1  | 000858 | 五粮液  | 5,600  | 1,011,864.00 | 9.41                 |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 4,400  | 986,832.00   | 9.17                 |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 500    | 863,500.00   | 8.03                 |
| 4  | 600809 | 山西汾酒 | 3,000  | 854,970.00   | 7.95                 |
| 5  | 000596 | 古井贡酒 | 3,200  | 854,080.00   | 7.94                 |
| 6  | 002304 | 洋河股份 | 4,800  | 770,400.00   | 7.16                 |
| 7  | 600702 | 舍得酒业 | 4,600  | 732,228.00   | 6.81                 |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 22,400 | 694,400.00   | 6.46                 |
| 9  | 600309 | 万华化学 | 6,400  | 592,960.00   | 5.51                 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 8,000  | 414,400.00   | 3.85                 |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 12,700 | 410,464.00   | 3.82                 |
| 12 | 600690 | 海尔智家 | 5,800  | 141,868.00   | 1.32                 |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 3,800  | 141,588.00   | 1.32                 |
| 14 | 601318 | 中国平安 | 3,000  | 141,000.00   | 1.31                 |
| 15 | 000002 | 万科A  | 7,200  | 131,040.00   | 1.22                 |
| 16 | 300059 | 东方财富 | 6,580  | 127,652.00   | 1.19                 |
| 17 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,300  | 127,149.00   | 1.18                 |
| 18 | 002372 | 伟星新材 | 5,700  | 121,638.00   | 1.13                 |
| 19 | 002415 | 海康威视 | 3,200  | 110,976.00   | 1.03                 |
| 20 | 000799 | 酒鬼酒  | 800    | 110,352.00   | 1.03                 |
| 21 | 000786 | 北新建材 | 3,900  | 100,932.00   | 0.94                 |
| 22 | 002027 | 分众传媒 | 12,700 | 84,836.00    | 0.79                 |
| 23 | 603899 | 晨光股份 | 1,500  | 82,470.00    | 0.77                 |
| 24 | 603198 | 迎驾贡酒 | 1,200  | 75,336.00    | 0.70                 |
| 25 | 000963 | 华东医药 | 1,400  | 65,520.00    | 0.61                 |
| 26 | 603369 | 今世缘  | 1,100  | 55,990.00    | 0.52                 |
| 27 | 600660 | 福耀玻璃 | 1,400  | 49,098.00    | 0.46                 |
| 28 | 603517 | 绝味食品 | 800    | 48,872.00    | 0.45                 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 29 | 603345 | 安井食品 | 300   | 48,564.00 | 0.45 |
| 30 | 002508 | 老板电器 | 1,600 | 44,416.00 | 0.41 |
| 31 | 002262 | 恩华药业 | 1,500 | 36,825.00 | 0.34 |
| 32 | 002507 | 涪陵榨菜 | 1,400 | 36,078.00 | 0.34 |
| 33 | 000661 | 长春高新 | 200   | 33,290.00 | 0.31 |
| 34 | 002271 | 东方雨虹 | 900   | 30,213.00 | 0.28 |
| 35 | 000860 | 顺鑫农业 | 900   | 26,838.00 | 0.25 |
| 36 | 600298 | 安琪酵母 | 500   | 22,610.00 | 0.21 |
| 37 | 600872 | 中炬高新 | 400   | 14,748.00 | 0.14 |
| 38 | 002032 | 苏泊尔  | 200   | 9,892.00  | 0.09 |

#### 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<br>(%) |
|----|--------|------|------------|--------------------|
| 1  | 600809 | 山西汾酒 | 649,369.00 | 5.43               |
| 2  | 600702 | 舍得酒业 | 580,750.00 | 4.86               |
| 3  | 000596 | 古井贡酒 | 519,049.00 | 4.34               |
| 4  | 002304 | 洋河股份 | 427,834.00 | 3.58               |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 230,873.00 | 1.93               |
| 6  | 600309 | 万华化学 | 221,622.00 | 1.85               |
| 7  | 000858 | 五粮液  | 174,090.00 | 1.46               |
| 8  | 600519 | 贵州茅台 | 162,100.00 | 1.36               |
| 9  | 000568 | 泸州老窖 | 132,892.00 | 1.11               |
| 10 | 000799 | 酒鬼酒  | 124,976.00 | 1.04               |
| 11 | 600276 | 恒瑞医药 | 111,460.00 | 0.93               |
| 12 | 603899 | 晨光股份 | 79,263.00  | 0.66               |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 79,058.00  | 0.66               |
| 14 | 300059 | 东方财富 | 68,474.00  | 0.57               |
| 15 | 603198 | 迎驾贡酒 | 64,071.00  | 0.54               |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 16 | 000963 | 华东医药 | 63,505.00 | 0.53 |
| 17 | 603345 | 安井食品 | 59,334.00 | 0.50 |
| 18 | 000651 | 格力电器 | 53,459.00 | 0.45 |
| 19 | 000661 | 长春高新 | 52,600.00 | 0.44 |
| 20 | 002311 | 海大集团 | 50,320.00 | 0.42 |

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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<br>(%) |
|----|--------|------|------------|--------------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 314,546.00 | 2.63               |
| 2  | 688239 | 航宇科技 | 304,185.17 | 2.54               |
| 3  | 600276 | 恒瑞医药 | 285,706.00 | 2.39               |
| 4  | 000002 | 万科A  | 229,605.00 | 1.92               |
| 5  | 000651 | 格力电器 | 183,006.00 | 1.53               |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 182,138.00 | 1.52               |
| 7  | 688707 | 振华新材 | 171,134.87 | 1.43               |
| 8  | 000333 | 美的集团 | 160,106.00 | 1.34               |
| 9  | 688305 | 科德数控 | 146,891.12 | 1.23               |
| 10 | 600309 | 万华化学 | 143,062.00 | 1.20               |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 131,646.00 | 1.10               |
| 12 | 688509 | 正元地信 | 89,357.07  | 0.75               |
| 13 | 000568 | 泸州老窖 | 85,137.00  | 0.71               |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 78,198.00  | 0.65               |
| 15 | 688772 | 珠海冠宇 | 69,830.85  | 0.58               |
| 16 | 688697 | 纽威数控 | 63,105.56  | 0.53               |
| 17 | 600779 | 水井坊  | 56,336.00  | 0.47               |
| 18 | 002236 | 大华股份 | 53,710.00  | 0.45               |
| 19 | 688071 | 华依科技 | 52,108.29  | 0.44               |
| 20 | 000538 | 云南白药 | 49,131.00  | 0.41               |

#### 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 | 4,601,882.00 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,871,958.67 |

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 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。

### 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。

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 | 1,052.39 |
| 2  | 应收清算款 | -        |
| 3  | 应收股利  | -        |
| 4  | 应收利息  | -        |
| 5  | 应收申购款 | 6,107.65 |
| 6  | 其他应收款 | -        |
| 7  | 待摊费用  | -        |
| 8  | 其他    | -        |
| 9  | 合计    | 7,160.04 |

#### 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 |
| 格林伯元灵活 | 1,144    | 3,797.04  | 1,463,957.93 | 33.70% | 2,879,852.16 | 66.30% |

|           |       |          |              |        |              |        |
|-----------|-------|----------|--------------|--------|--------------|--------|
| 配置A       |       |          |              |        |              |        |
| 格林伯元灵活配置C | 1,209 | 3,084.17 | 572,126.02   | 15.34% | 3,156,631.86 | 84.66% |
| 合计        | 2,353 | 3,430.76 | 2,036,083.95 | 25.22% | 6,036,484.02 | 74.78% |

## 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<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 | 格林伯元灵活配置A | 3,693.24      | 0.09%    |
|                  | 格林伯元灵活配置C | 141.95        | 0.00%    |
|                  | 合计        | 3,835.19      | 0.05%    |

## 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<br>(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 | 格林伯元灵活配置A | 0~10                  |
|                                | 格林伯元灵活配置C | 0~10                  |
|                                | 合计        | 0~10                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 格林伯元灵活配置A | 0                     |
|                                | 格林伯元灵活配置C | 0                     |
|                                | 合计        | 0                     |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|  |           |           |
|--|-----------|-----------|
|  | 格林伯元灵活配置A | 格林伯元灵活配置C |
|--|-----------|-----------|

|                            |               |                |
|----------------------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日(2018年02月06日)基金份额总额 | 11,551,784.92 | 241,060,453.47 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 3,374,564.50  | 4,321,662.41   |
| 本报告期基金总申购份额                | 2,710,576.17  | 2,193,021.98   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 1,741,330.58  | 2,785,926.51   |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -             | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 4,343,810.09  | 3,728,757.88   |

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

2022年12月31日，基金管理人发布公告，聘任龙元伟先生担任公司副总经理，任职日期为2022年12月30日。上述事项经基金管理人董事会审议通过，并按现行法律法规履行备案程序。

#### (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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况



无。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

## 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 |    |
| 长城证券 | 2      | -            | -            | -         | -          | -  |
| 恒泰证券 | 2      | 8,473,840.67 | 100.00%      | 6,196.87  | 100.00%    | -  |
| 银河证券 | 2      | -            | -            | -         | -          | -  |

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

无。

### 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旗下部分基金季度报告提示性公告          | 《证券日报》              | 2022-01-24 |
| 2  | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金2021年第四季度报告       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-01-24 |
| 3  | 格林基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告          | 《证券日报》              | 2022-03-31 |
| 4  | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金2021年年度报告         | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-03-31 |
| 5  | 格林基金管理有限公司旗下部分基金2022年第一季度报告提示性公告   | 《证券日报》              | 2022-04-22 |
| 6  | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金2022年第一季度报告       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-04-22 |
| 7  | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新        | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-31 |
| 8  | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）2022年第1号 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-05-31 |
| 9  | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金2022年第二季度报告       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-07-21 |
| 10 | 格林基金管理有限公司旗下部分基金2022年第二季度报告提示性公告   | 《证券日报》              | 2022-07-21 |

|    |                                  |                     |            |
|----|----------------------------------|---------------------|------------|
| 11 | 格林基金管理有限公司旗下部分基金2022年中期报告提示性公告   | 《证券日报》              | 2022-08-31 |
| 12 | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金2022年中期报告       | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-08-31 |
| 13 | 格林基金管理有限公司旗下部分基金2022年第三季度报告提示性公告 | 《证券日报》              | 2022-10-26 |
| 14 | 格林伯元灵活配置混合型证券投资基金2022年第三季度报告     | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2022-10-26 |

## §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

本报告期内，本基金单一投资者持有份额比例没有达到或者超过总份额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伯元灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《格林伯元灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《格林伯元灵活配置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  
二〇二三年三月三十一日