

格林30天滚动持有债券型证券投资基金

2024年第4季度报告

2024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

报告送出日期:2025年01月22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遵规守信情况的说明	7
4.3 公平交易专项说明	7
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	8
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	8
§5 投资组合报告	8
5.1 报告期末基金资产组合情况	8
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	9
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	9
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	10
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	10
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	11
§6 开放式基金份额变动	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	12
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	12
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	12
§8 影响投资者决策的其他重要信息	12
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	12
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	12
§9 备查文件目录	12
9.1 备查文件目录	12
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

§1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据基金合同约定，于2025年1月21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2024年10月01日起至2024年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	格林30天滚动持有债券	
基金主代码	021559	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年08月13日	
报告期末基金份额总额	41,334,830.71份	
投资目标	在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金投资策略包括债券类属配置策略、久期管理策略、收益率曲线策略、信用债券投资策略、国债期货投资策略。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%	
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	
下属分级基金的基金简称	格林30天滚动持有债券A	格林30天滚动持有债券C
下属分级基金的交易代码	021559	021560
报告期末下属分级基金的份额总额	1,727,484.94份	39,607,345.77份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024年10月01日 - 2024年12月31日)	
	格林30天滚动持有债券A	格林30天滚动持有债券C
1.本期已实现收益	16,421.49	474,417.24
2.本期利润	23,571.75	941,780.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0122	0.0099
4.期末基金资产净值	1,759,530.80	40,305,678.30
5.期末基金份额净值	1.0186	1.0176

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

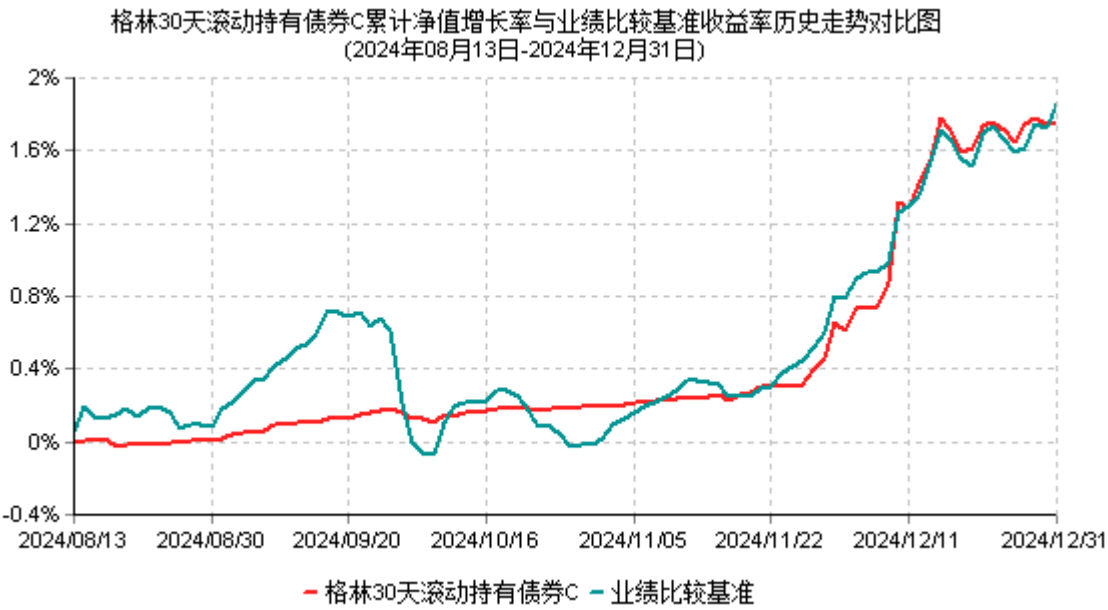
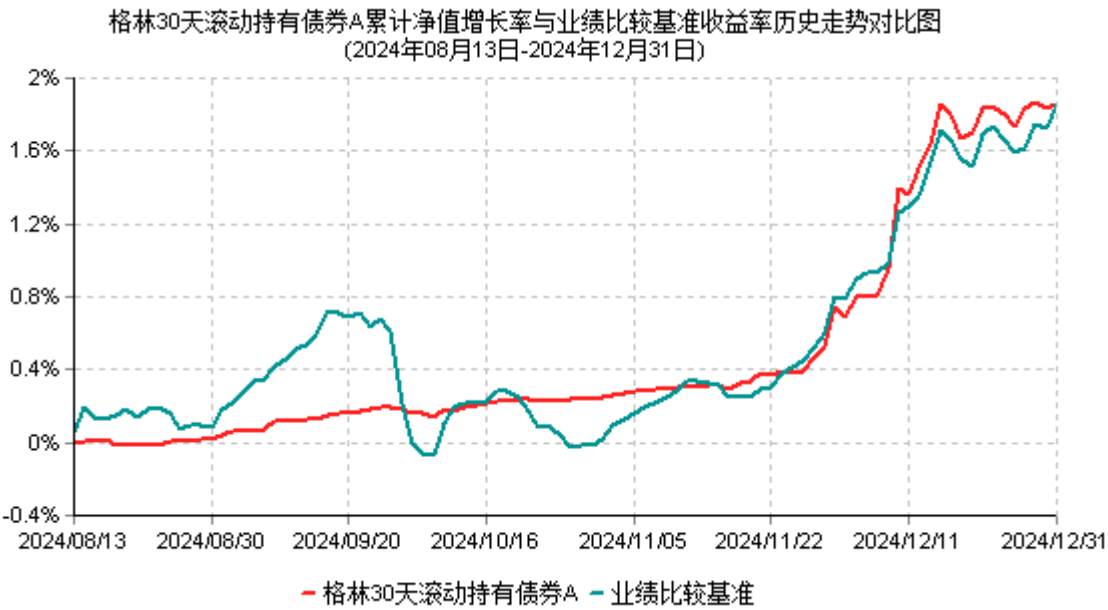
格林30天滚动持有债券A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.70%	0.08%	1.86%	0.08%	-0.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.86%	0.07%	1.86%	0.08%	0.00%	-0.01%

格林30天滚动持有债券C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.63%	0.08%	1.86%	0.08%	-0.23%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.76%	0.07%	1.86%	0.08%	-0.10%	-0.01%

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	离任		

		日期	日期		
高洁	基金经理	2024-08-13	-	12	高洁女士，美国旧金山大学金融分析硕士。曾任吉林银行金融市场部债券交易员，民生银行直销银行事业部基金类产品经理，中英益利资产管理股份有限公司固定收益部投资经理。2020年5月加入格林基金，曾任固定收益部基金经理助理，现任基金经理。2020年12月2日至今，担任格林日鑫月熠货币市场基金基金经理；2020年12月2日至今，担任格林中短债债券型证券投资基金基金经理；2024年1月11日至今，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；2024年8月13日至今，担任格林30天滚动持有债券型证券投资基金基金经理；2024年9月20日至今，担任格林中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。
索隽石	基金经理	2024-11-29	-	14	索隽石先生，北京大学软件工程专业硕士，曾先后在信达证券、中信建投基金、平安信托、天风证券和天风（上海）证券资管任职，分别担任投资经理、基金经理、投资主办等职务，2023年11月加入格林基金，任特定客户资产管理部绝对收益策略部总监，现任固定收益二部基金经理。2024年4月24日至今，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； 2024年4月24日至今，担任格林鑫利六个月持有期混合型证券投资基金基金经理； 2024年11月29日至今，担任格林30天滚动持有债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

- 1、上述任职日期和离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
- 2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《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。

4.3.2 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

进入四季度，受权益市场回暖、股债“跷跷板”效应以及理财基金赎回压力等因素影响，债券市场的情绪波动加大。这导致部分债券品种面临抛售压力，收益率上升，同时增发国债、特殊再融资债等增量政策的推出，也对市场造成一定的供给冲击，随着央行在买断式回购和公开市场的操作，平抑了一些季节性波动，市场情绪有所恢复。12月利率走势由震荡转向下行，央行多次监督调降银行各类存款的利率后，银行的负债端压力有了明显好转，报告期内，中短端利率整体呈下行趋势，同时配置资金抢跑，长端利率也快速下行，收益率曲线整体下移，牛陡格局形成。

第四季度本基金以中长久期利率债和中短久期信用债相结合形式进行配置交易，同时配有逆回购平衡票息和波动，抓住利率快速下行的机会，获得资本利得收益。

展望2025年，广义赤字扩张与货币适度宽松将共同塑造偏友好的流动性环境，地产投资或难有较大起色，政策定调为促进房地产市场止跌企稳、稳住楼市，大幅增长的概率低。消费是增长的主要抓手，预计有所提振，但提振空间受收入预期和就业压力制约。出口压力大，且应对手段相对有限。2025年逆周期调节是核心，中央财政发力是政策的主线。财政赤字率或提高，为GDP增长带来助力。积极的财政政策将重点落在化债、补充银行资本、稳地产以及扩内需等方面。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林30天滚动持有债券A基金份额净值为1.0186元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.70%，同期业绩比较基准收益率为1.86%；截至报告期末格林30天滚动持有债券C基金份额净值为1.0176元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.63%，同期业绩比较基准收益率为1.86%。

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净资产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	24,971,496.74	57.67
	其中：债券	24,971,496.74	57.67
	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	16,802,596.14	38.81
	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	1,515,915.72	3.50
8	其他资产	7,715.90	0.02
9	合计	43,297,724.50	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投资股票。

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	4,262,233.73	10.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,709,263.01	49.23
	其中：政策性金融债	20,709,263.01	49.23
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	-	-
10	合计	24,971,496.74	59.36

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	220208	22国开08	100,000	10,456,660.27	24.86
2	240208	24国开08	100,000	10,252,602.74	24.37
3	019740	24国债09	10,000	1,012,633.97	2.41
4	019743	24国债11	9,000	948,780.99	2.26
5	019748	24国债14	6,000	619,077.53	1.47

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

本基金参与国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市 值(元)	公允价值变 动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-

国债期货投资本期收益（元）	-30,876.03
国债期货投资本期公允价值变动（元）	-

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金管理人充分考虑国债期货的风险及流动性特征，进行了一定的套期保值操作，以降低投资组合的整体风险。

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2024年12月27日因贷款支付管理不到位、向未取得行政许可的项目发放贷款，被国家金融监督管理总局北京金融监管局罚款60万元，相关文号：京金罚决字〔2024〕43号。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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

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	7,715.90
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	7,715.90

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

	格林30天滚动持有债券 A	格林30天滚动持有债券 C
报告期期初基金份额总额	7,953,784.48	267,637,899.28
报告期期间基金总申购份额	601,081.66	161,407.69
减：报告期期间基金总赎回份额	6,827,381.20	228,191,961.20
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	1,727,484.94	39,607,345.77

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

本报告期内，本基金单一投资者持有份额比例没有达到或超过总份额20%的情况。

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30天滚动持有债券型证券投资基金募集注册的文件；

- 2、《格林30天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《格林30天滚动持有债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《格林30天滚动持有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

2025年01月22日