

## 格林中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2025年07月10日

送出日期：2025年07月11日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

|         |   |             |   |
|---------|---|-------------|---|
| 基金简称    | 格林中证同业存单AAA指数 7天持有期   | 基金代码        | 021903  |
| 基金管理人   | 格林基金管理有限公司  | 基金托管人       | 中国民生银行股份有限公司  |
| 基金合同生效日 | 2024年09月20日   | 上市交易所及上市日期  | 暂未上市  |
| 基金类型    | 混合型   | 交易币种        | 人民币   |
| 运作方式    | 其他开放式   | 开放频率        | 每个开放日开放申购,但对于每份基金份额设定7天最短持有期; 对于每份基金份额,在基金份额的7天持有期到期日前(不含当日),基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请;基金份额的7天持有期到期日起(含当日),基金份额持有人可按照基金合同和招募说明书的规定对该基金份额提出赎回申请。 |
| 基金经理    | 开始担任本基金基金经理的日期  | 证券从业日期      |   |
| 高洁      | 2024年09月20日   | 2012年11月01日 |   |
| 其他      | 《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。 |             |   |

## 二、基金投资与净值表现

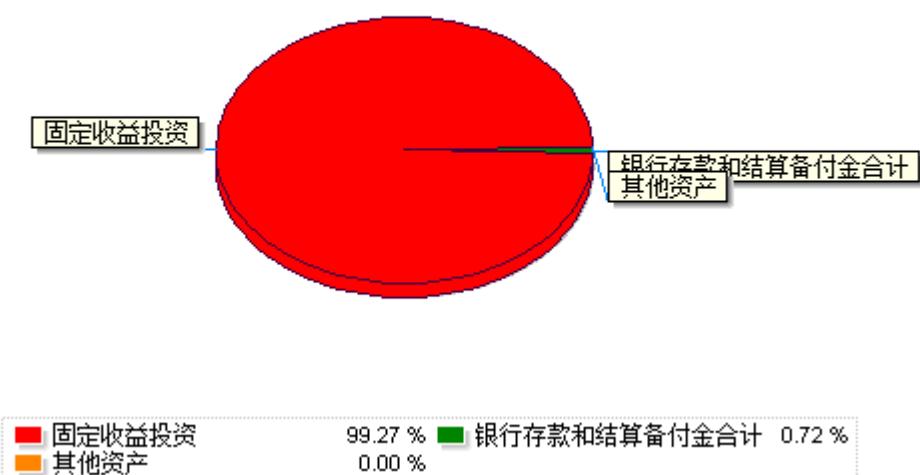
## (一) 投资目标与投资策略

投资者可阅读《格林中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》及更新第九部分“基金的投资”了解详细情况。

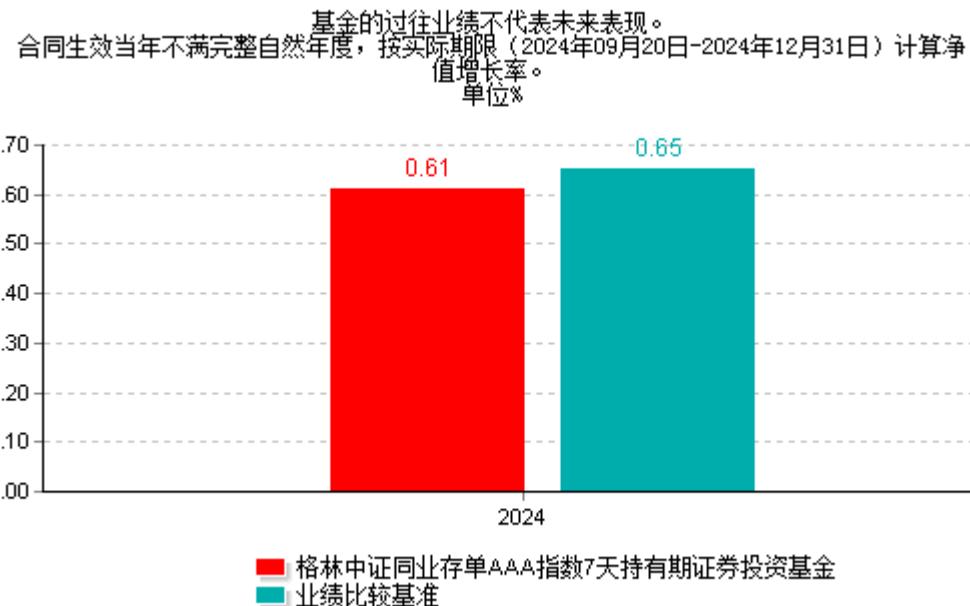
|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。   |
| 投资范围   | <p>本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券（包括依法上市的国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款等）以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。</p> <p>本基金不投资于股票、也不投资于可转换债券、可交换债券以及其他带有权益属性的金融工具。</p> <p>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。</p> |
| 主要投资策略 | 本基金投资策略主要包括：指数化投资策略；替代性策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略。   |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单AAA指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币一年定期存款利率(税后) $\times$ 5%。   |
| 风险收益特征 | <p>本基金为混合型基金，但主要投资于同业存单，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、偏股混合型基金。</p> <p>本基金属于指数基金，采用抽样复制策略，跟踪中证同业存单AAA指数，其风险收益特征与标的指数所表征的存单市场组合的风险收益特征相似。</p>   |

## (二) 投资组合资产配置图表 / 区域配置图表

数据截止日：2025年03月31日



### (三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



## 三、 投资本基金涉及的费用

### (一) 基金销售相关费用

以下费用在认购 / 申购 / 赎回基金过程中收取：

| 费用类型     | 份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N) | 收费方式/费率   | 备注 |
|----------|---------------------------|---|----|
| 申购费（前收费） |                           | 本基金不收取申购费用  |    |
| 赎回费      |                           | 本基金每份基金份额设定7天 最短持有期，在基金份额的最短持有期到期日及最短持有期到期日之后，基金份额持有人可提出赎回申请，赎回时不收取赎回费。 |    |

### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额         | 收取方        |
|------|---------------------|------------|
| 管理费  | 按前一日基金资产净值计提0.20%/年 | 基金管理人、销售机构 |

|       |   |        |
|-------|---|--------|
| 托管费   | 按前一日基金资产净值计提0.05%/年   | 基金托管人  |
| 销售服务费 | 按前一日基金资产净值计提0.20%/年   | 销售机构   |
| 审计费用  | 45,000.00   | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00  | 规定披露报刊 |
|       | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、诉讼费和仲裁费等按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。 | 相关服务机构 |

注:

- 1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负, 按实际发生额从基金资产扣除。
- 2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用, 非单个份额类别费用, 且年金额为预估值, 最终实际金额以基金定期报告披露为准。

### (三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额, 在持有期间, 投资者需支出的运作费率如下表:

|     | 基金运作综合费率(年化) |
|-----|--------------|
| 持有期 | 0.46%        |

## 四、 风险揭示与重要提示

### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险, 投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资于本基金的主要风险包括: 市场风险、流动性风险、信用风险、积极管理风险、操作或技术风险、政策变更风险、其他风险等。

本基金的特有风险包括:

1、每份认申购、转换转入份额最短期限锁定持有的风险

本基金对于每份基金份额设定了7天持有期限, 且本基金不上市交易, 因此投资者持有本基金将面临在最短持有期到期前不能赎回基金份额的流动性风险。投资者应当根据自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策。

2、资产支持证券投资风险

本基金参与资产支持证券投资的, 可能面临信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。本基金将通过严谨的投资研究对资产支持证券投资进行有效的风险评估和控制。

3、指数化投资相关风险

本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的80%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动。由于本基金在多数情况下将维持较高的同业存单仓位，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

#### （1）跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### （2）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式、与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### （3）成份券停止交易或违约的风险

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，当标的指数成份券发生明显负面事件面临违约风险时，可能出现导致本基金的跟踪偏离度和跟踪误差扩大的风险。

### 4、基金合同终止的风险

出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。因此，投资人将面临基金合同可能终止风险。

## （二）重要提示

格林中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金经中国证监会2024年7月8日证监许可【2024】1029号文注册。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁人均具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

## 五、 其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站【网址：[www.china-greenfund.com](http://www.china-greenfund.com)】【客服电话：4001000501】

基金合同、托管协议、招募说明书及其更新

定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

基金份额净值

基金销售机构及联系方式

其他重要资料

## 六、 其他情况说明

无