

格林泓鑫纯债债券型证券投资基金

2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人:格林基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 03 月 29 日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年10月29日起至2018年12月31日止（本基金合同生效日为2018年10月29日）。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	格林泓鑫纯债	
基金主代码	006184	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年10月29日	
基金管理人	格林基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	260,591,306.76份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	格林泓鑫纯债A	格林泓鑫纯债C
下属分级基金的交易代码	006184	006185
报告期末下属分级基金的份额总额	250,054,768.76份	10,536,538.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将在分析和判断国际国内宏观经济形势、宏观调控政策、资金供求关系、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等重要因素的基础上，动态调整组合仓位、久期和债券配置结构，精选债券，控制风险，获取收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险与预期收益高于货币

	市场基金，低于混合型、股票型基金，属于证券投资基金中的较低风险和较低预期收益产品。
--	---

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙会	郭明
	联系电话	010-50890709	(010) 66105799
	电子邮箱	sunhui@china-greenfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4001000501	95588
传真		010-50890725	(010) 66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.china-greenfund.com/
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区东三环中路5号财富金融中心58层04、05、06室

§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	本期2018年10月29日（基金合同生效日）- 2018年12月31日	
	格林泓鑫纯债A	格林泓鑫纯债C
本期已实现收益	1,253,493.28	186,173.64

本期利润	1,424,580.43	197,911.18
加权平均基金份额本期利润	0.0057	0.0042
本期基金份额净值增长率	0.57%	0.56%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0050	0.0049
期末基金资产净值	251,479,385.80	10,595,825.39
期末基金份额净值	1.0057	1.0056

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

格林泓鑫纯债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
自基金合同生效起至今	0.57%	0.02%	1.47%	0.05%	-0.90%	-0.03%

格林泓鑫纯债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

自基金合同 生效起至今	0.56%	0.02%	1.47%	0.05%	-0.91%	-0.03%
----------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

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

格林泓鑫纯债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10月29日-2018年12月31日)

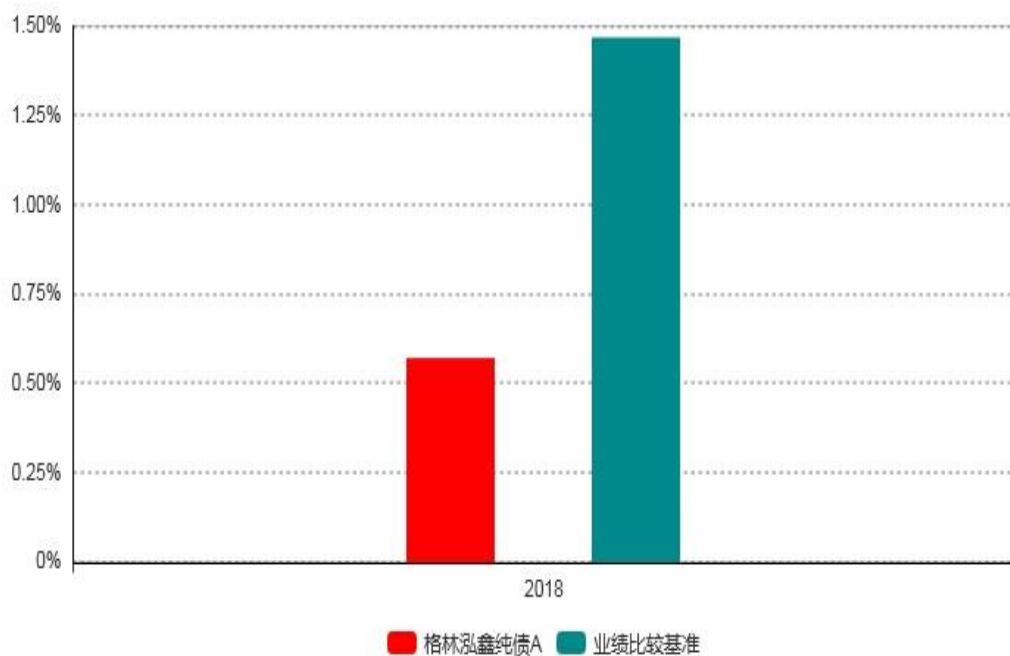


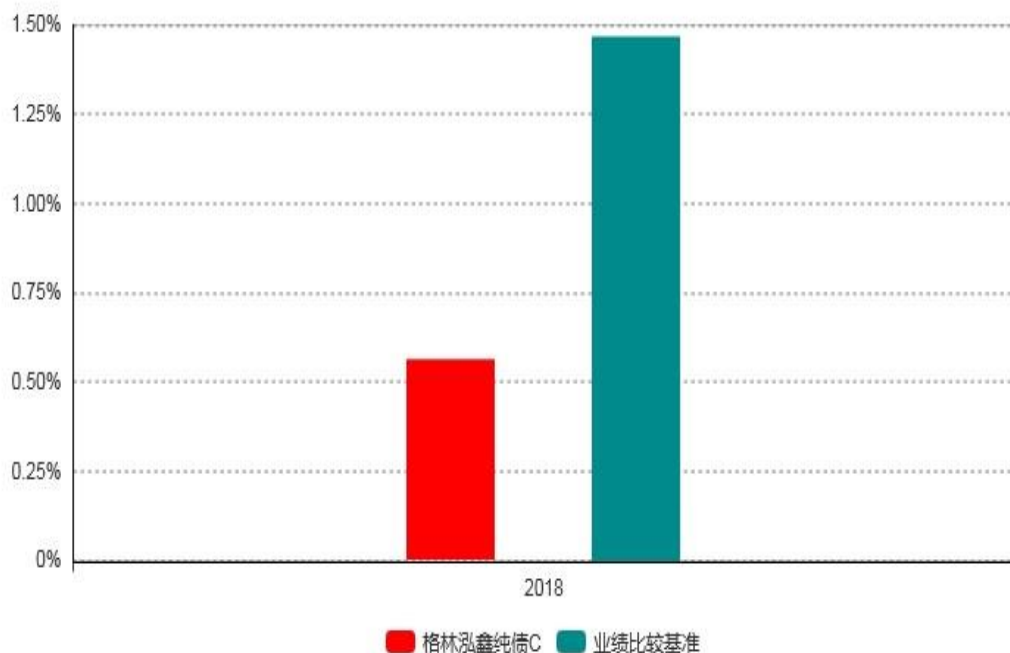
格林泓鑫纯债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年10月29日-2018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

本基金本年度未分配利润。

§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1亿元整，注册地为中国北京朝阳区。经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2018年12月31日，格林基金管理有限公司共管理四只公募基金，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和格林伯锐灵活配置混合型证券投资基金。

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		
宋东旭	本基金基金经理，格林日鑫月熠货币市场基金基金经理，格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2018-10-29	-	7	宋东旭先生，中央财经大学数理金融学士，Rutgers金融数学硕士。曾供职于摩根大通首席投资办公室，负责固定收益类资产的投资。现任格林基金固定收益部基金经理。
张晓圆	本基金基金经理	2018-12-03	-	6	张晓圆女士，天津财经大学硕士。曾任渤海证券固定收益总部承销项目经理、综合质控部副经理、交易一部副经理、投资交易部副经理，先后从事债券承销、投资交易等工作。2018年5月加入格林基金，曾任专户投资经理，现任格林泓鑫纯债债券型证券

					投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-----------

注：1、上述任职日期和离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《格林泓鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金无重大违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 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内的公平交易程序；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

截至年末，债券市场整体收益率水平下行幅度较大。从基本面来看，经济下行压力继续增大，呈现“供需两弱、量价齐缩”的基面特征。2018年12月，官方制造业PMI49.4%，大幅下降0.6个百分点，跌破枯荣线，再创2016年1月以来新低。2018年10月和11月，新增信贷和社融数据不及预期，反映出银行信用扩张动力依旧萎靡。从货币政策方面来看，央行12月中旬创设TMLF，利率比MLF低15bp，反应央行呵护流动性取向未变。全球央

行纷纷转鸽，下调经济预期，2018年11月底美联储开始不断释放鸽派信号，海外因素对利率下行制约减弱。叠加中美贸易战不确定性加大，市场对经济下行形成较强的一致预期。

本基金于2018年10月29日起成立运作，自成立以来，一直以稳健投资为主，11月为本基金封闭期，主要进行了短久期高等级信用债及利率债、存单存款及回购的配置。进入开放期后，为减少跨年资金对收益的扰动，并同时积累一定的安全垫收益，本基金以短久期高评级债配置为主，并适当增加了跨年逆回购比例，在12月末跨年资金逐步缓解的时候，预计年后收益率将进一步下行，因而适当增加了部分杠杆比例。本基金整体持仓结构相对均衡，流动性安排较为合理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林泓鑫纯债A基金份额净值为1.0057元，本报告期内该类基金份额净值增长率为0.57%，同期业绩比较基准收益率为1.47%；截至报告期末格林泓鑫纯债C基金份额净值为1.0056元，本报告期内该类基金份额净值增长率为0.56%，同期业绩比较基准收益率为1.47%。

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2019年，中国宏观经济的发展依然会紧紧围绕供给侧结构性改革来展开，尽管经济增长水平中枢还会下移，但部分结构性指标将出现改善，金融对实体经济的支持力度不断加大，预计是社融、固定资产投资等主要经济指标将会企稳。虽然近期政府出台了一系列的改革措施，但是各种政策从实施到实际影响经济需要一段时间，经济真正企稳仍需时日。

对于债券市场投资而言，当前的利好因素体现在三个方面：一是经济基本面继续下行，通胀水平保持稳定，全社会的资本回报率走低；二是央行延续稳健的货币政策，存款准备金率未来仍有下调空间，为了疏通货币政策传导机制，各类创新型的货币工具和配套政策值得期待；三是美国经济复苏放缓，美国加息周期即将结束，海外因素对国内

利率下行的制约消退。另外，随着货币政策宽松和民企纾困政策落地，企业的再融资风险趋降，信用风险得到缓释，结构性交易机会也会显现。

然而在关注机会的同时，也要防控市场风险：一是受缴准、缴税、债券供求关系不平衡等因素的影响，短时间的资金面波动依然存在，需要关注流动性风险。二是宽信用政策可能超预期，微观激励机制重建、民企纾困加速落地等因素对利率债的投资需求产生一定的抑制。三是股票等权益市场的复苏，投资者风险偏好的提升也会对债券投资产生影响。

综合来看，2019年中国的经济依然会稳中求进，各项改革措施将继续推进。债券市场投资波动性加大，预计很难重现2018年的债券牛市，更需要基金管理人精耕细作，把握政策脉搏，增强市场敏感度，以期获得良好的投资收益。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者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

本报告期内，本基金托管人在对格林泓鑫纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，格林泓鑫纯债债券型证券投资基金的管理人格林基金管理有限公司在格林泓鑫纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对格林基金管理有限公司编制和披露的格林泓鑫纯债债券型证券投资基金2018年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计了本基金财务报表，包括2018年12月31日的资产负债表，2018年10月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注，并出具了普华永

道中天审字(2019)第23257号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：格林泓鑫纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	2,622,882.89
结算备付金		2,585,888.20
存出保证金		7,204.57
交易性金融资产	7.4.7.2	223,783,391.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		223,783,391.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	80,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	3,096,144.03
应收股利		-

应收申购款		4,996.00
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		312,100,506.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日
负债：		
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		49,799,485.30
应付证券清算款		-
应付赎回款		20.09
应付管理人报酬		66,636.64
应付托管费		22,212.22
应付销售服务费		897.70
应付交易费用	7.4.7.7	10,690.76
应交税费		21,279.10
应付利息		43,539.60
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	60,534.09
负债合计		50,025,295.50
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	260,591,306.76

未分配利润	7.4.7.10	1,483,904.43
所有者权益合计		262,075,211.19
负债和所有者权益总计		312,100,506.69

注：1.报告截止日2018年12月31日，格林泓鑫纯债A基金份额净值1.0057元，基金份额总额250,054,768.76份；格林泓鑫纯债C基金份额净值1.0056元，基金份额总额10,536,538.00份。格林泓鑫纯债债券型证券投资基金份额总额合计为260,591,306.76份。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：格林泓鑫纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018年10月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年10月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日
一、收入		2,024,205.94
1.利息收入		1,971,937.94
其中：存款利息收入	7.4.7.11	136,521.75
债券利息收入		1,191,536.13
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		643,880.06
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-130,558.03

其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-130,558.03
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	182,824.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1.34
减：二、费用		401,714.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	153,249.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	51,083.13
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	7,825.06
4. 交易费用	7.4.7.19	5,907.75
5. 利息支出		113,218.53
其中：卖出回购金融资产支出		113,218.53
6. 税金及附加		3,243.70
7. 其他费用	7.4.7.20	67,186.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,622,491.61
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,622,491.61

注：本基金合同生效日为2018年10月29日，本期是指2018年10月29日至2018年12月31日，无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：格林泓鑫纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018年10月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018年10月29日（基金合同生效日）至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	333,549,902.74	-	333,549,902.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,622,491.61	1,622,491.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-72,958,595.98	-138,587.18	-73,097,183.16
其中：1.基金申购款	48,310.10	131.11	48,441.21
2.基金赎回款	-73,006,906.08	-138,718.29	-73,145,624.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益 (基金净值)	260,591,306.76	1,483,904.43	262,075,211.19
---------------------	----------------	--------------	----------------

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

格林泓鑫纯债债券型证券投资基金(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[2018]611号《关于准予格林伯盈定期开放混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,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《格林泓鑫纯债债券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333,541,326.24元,业经天健会计师事务所(特殊普通合伙)天健验[2018]1-69号予以验证。经向中国证监会备案,《格林泓鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》于2018年10月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为333,549,902.74份基金份额,其中认购资金利息折合8,576.50份基金份额。本基金的基金管理人为格林基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")。

根据《格林泓鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》和《格林泓鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金分设两类基金份额:A类基金份额和C类基金份额。收取认/申购费及赎回费,但不收取销售服务费的基金份额类别称为A类基金份额;不收取认/申购费,但收取赎回费及销售服务费的基金份额类别称为C类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码,两类基金份额收取不同的认/申购费、赎回费及销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《格林泓鑫纯债债券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债券(国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、分离交易可转换债券的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具(含同业存单)、国债期货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。本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：投资债券的比例不低于基金资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中债综合全价指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则 - 基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、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》、《格林泓鑫纯债债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的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2018年12月31日的财务状况以

及2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券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

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，

那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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。

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确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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、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债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
格林基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本报告期(2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日)，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本报告期(2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日)，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本报告期(2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日)，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本报告期(2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日)，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期(2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日)，本基金无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	153,249.35
其中：支付销售机构的客户维护费	10.99

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0.30%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 × 0.30% / 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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	51,083.13

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	格林泓鑫纯债A	格林泓鑫纯债C	合计
格林基金管理有限公司	0.00	7,822.32	7,822.32
合计	0.00	7,822.32	7,822.32

注：1.本基金C类基金份额销售服务费年费率为0.10%，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 × 0.10% / 当年天数。

2.本基金A类基金份额不收取销售服务费。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内(2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日)，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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内(2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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(2018年12月31日),除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.8.5 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 2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年 12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,622,882.89	65,079.22

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

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内(2018年10月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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(2018年12月31日), 本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末(2018年12月31日), 本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额49,799,485.30元, 是以如下债券作为抵押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (张)	期末估值总额
1082139	10中信集MTN2	2019-01-02	101.30	200,000	20,260,000.00
1382085	13诚通MTN1	2019-01-04	102.92	100,000	10,292,000.00
101800792	18津城建MTN012A	2019-01-02	101.94	100,000	10,194,000.00
101801068	18浙能源MTN003	2019-01-02	103.01	100,000	10,301,000.00
合计				500,000	51,047,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末(2018年12月31日), 本基金无交易所市场债券正回购余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为223,783,391.00元，无属于第一、第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

98 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	223,783,391.00	71.70
	其中：债券	223,783,391.00	71.70
	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	80,000,000.00	25.63
	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	5,208,771.09	1.67
8	其他各项资产	3,108,344.60	1.00
9	合计	312,100,506.69	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,952,000.00	3.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,032,000.00	3.83
	其中：政策性金融债	10,032,000.00	3.83
4	企业债券	10,139,000.00	3.87
5	企业短期融资券	20,056,000.00	7.65
6	中期票据	144,561,391.00	55.16
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	29,043,000.00	11.08
9	其他	-	-
10	合计	223,783,391.00	85.39

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	1082139	10中信集MTN2	200,000	20,260,000.00	7.73
2	101455031	14宁国资MTN001	200,000	20,246,000.00	7.73
3	111819472	18恒丰银行CD472	200,000	19,288,000.00	7.36
4	101453021	14粤城建MTN001	123,900	12,599,391.00	4.81
5	101800070	18汇金MTN001	100,000	10,372,000.00	3.96

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。

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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 18恒丰银行CD472 (代码 : 111819472) 为本基金前五大持仓证券之一。2018年12月27日,中国人民银行上海分行对恒丰银行上海分行违反《征信业管理条例》和《个人信用信息基础数据库管理暂行办法》的行为,处以163万元罚款;2018年12月11日,中国人民银行重庆营业管理部对恒丰银行重庆分行违反有关反洗钱规定的行为,处以96

万元罚款，并对相关责任人员共处以罚款3万元；2018年8月16日，国家外汇管理局对恒丰银行温州分行未按规定尽职审核转口贸易真实性，凭企业虚假提单办理转口贸易付汇业务的违规行为，处以146.4万元罚款；2018年5月8日，中国银监会烟台监管分局对恒丰银行烟台分行违法违规办理商业承兑汇票转贴现业务的违规行为，处以150万元罚款。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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 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。

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	7,204.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,096,144.03
5	应收申购款	4,996.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,108,344.60

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

本基金本报告期末未持有股票。

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
格林泓 鑫纯债 A	245	1,020,631.71	250,003,750.00	99.98%	51,018.76	0.02%
格林泓 鑫纯债 C	18	585,363.22	0.00	0.00%	10,536,538.00	100.00%
合计	263	990,841.47	250,003,750.00	95.94%	10,587,556.76	4.06%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总 份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	格林泓鑫纯债A	1,656.61	0.00%
	格林泓鑫纯债C	9,501,867.52	90.18%
	合计	9,503,524.13	3.65%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	格林泓鑫纯债A	0~10
	格林泓鑫纯债C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	格林泓鑫纯债A	0
	格林泓鑫纯债C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	格林泓鑫纯债A	格林泓鑫纯债C
基金合同生效日(2018年10月29日)基金份额总额	250,043,487.81	83,506,414.93
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	14,894.50	33,415.60
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,613.55	73,003,292.53
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	250,054,768.76	10,536,538.00

注：总申购份额含红利再投、转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§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

2018年2月13日，基金管理人发布公告，增聘张兴先生担任格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

2018年3月2日，基金管理人发布公告，解聘李雪梅女士担任公司副总经理。

2018年8月16日，基金管理人发布公告，增聘宋东旭先生担任格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

2018年12月4日，基金管理人发布公告，增聘宋绍峰先生担任格林伯锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

2018年12月4日，基金管理人发布公告，增聘张晓圆女士担任格林泓鑫纯债债券型证券投资基金基金经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。本基金本报告期内应支付审计费用40,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 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	
山西证券	2	-	-	-	-	
渤海证券	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

告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

3、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
山西证券	100,301,688.81	100.00%	1,343,816,000.00	100.00%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20181029-20181231	99,999,000.00	0.00	0.00	99,999,000.00	38.37%
	2	20181029-20181231	100,003,500.00	0.00	0.00	100,003,500.00	38.38%
产品特有风险							

1、净值大幅波动的风险

由于本基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该机构投资者大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。

2、出现巨额赎回的风险

该机构投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。其他投资者的赎回申请也可能同时面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。

3、基金规模过小的风险

根据基金合同的约定，基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5,000万元情形。

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。

格林基金管理有限公司
二〇一九年三月二十九日