格林宏观回报混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新

编制日期：2025年06月11日

送出日期：2025年06月12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	格林宏观回报混合	基金代码	020062
基金简称C	格林宏观回报混合C	基金代码C	020063
基金管理人	格林基金管理有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2024年05月28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	契约型开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期
郑中华	2024年05月28日		2015年07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进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

注:本基金为偏股混合型。

二、 基金投资与净值表现

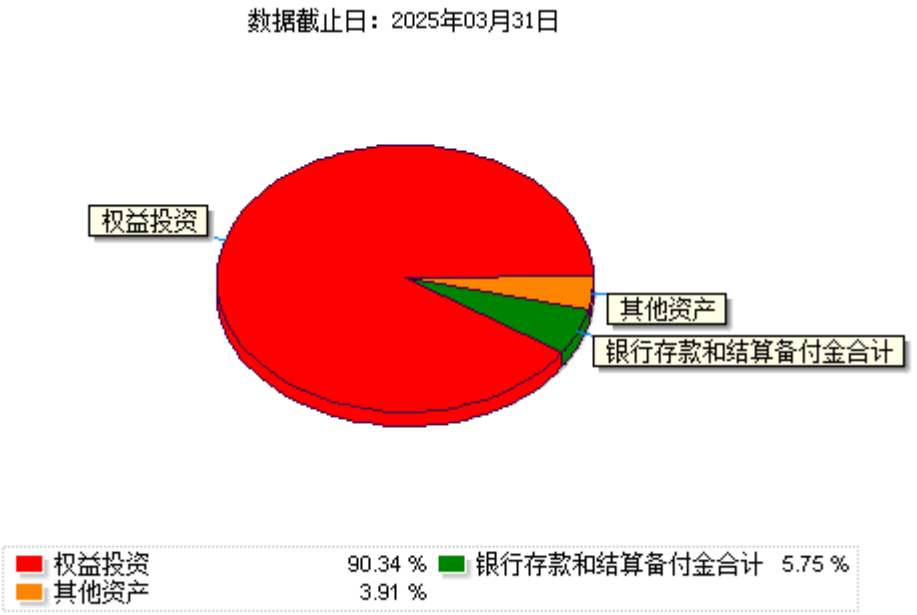
（一）投资目标与投资策略

投资者可阅读《格林宏观回报混合型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。

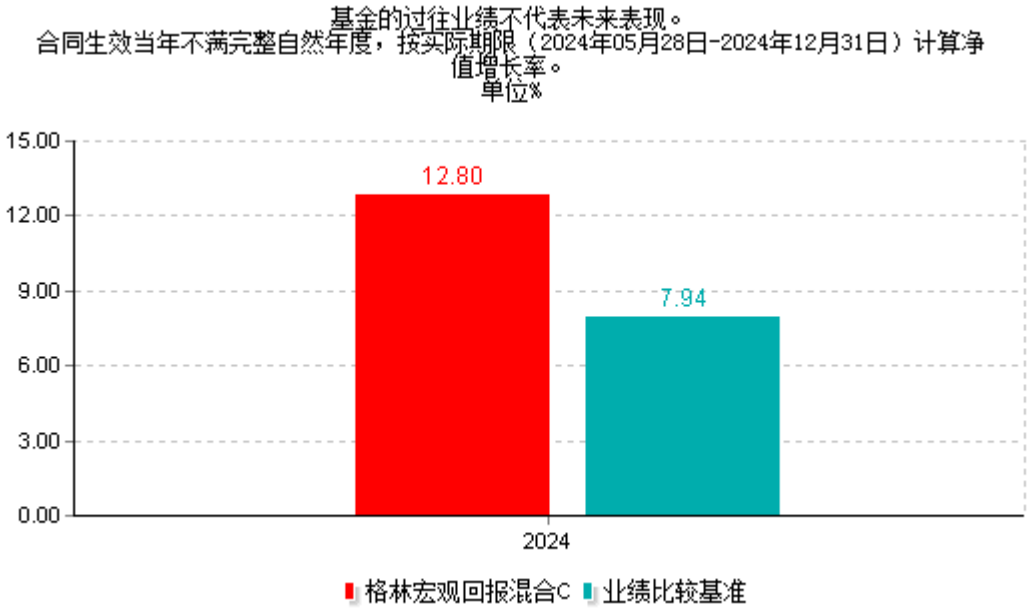
投资目标	本基金在深入研究经济、行业周期和上市公司的基础上，在严格控制风险和保障必要流动性的前提下，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创板及其他依法发行上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、同业存单、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存

	款、通知存款等)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券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：本基金股票资产占基金资产的比例60%-95%（其中，港股通标的股票占股票资产的比例为0%-50%）。投资于可交换债券和可转换债券（含分离交易可转债）合计比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终，本基金在扣除股指期货、国债期货、股票期权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、存出保证金和应收申购款等。 本基金参与股指期货、国债期货、股票期权交易，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等交易所的业务规则。 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。 本基金的投资范围包括港股通标的股票，基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。
主要投资策略	本基金的主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*70%+恒生指数收益率×10%+中债综合财富（总值）指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金还可投资港股通标的股票，可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

（二）投资组合资产配置图表 / 区域配置图表



（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
赎回费	0天<N<7天	赎回时一次性收取/1.50%	

	7天≤N<30天	赎回时一次性收取/0.50%	
	N≥30天	0.00%	

（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	每日按前一日基金资产净值计提/1.20%/每年	基金管理人和销售机构
托管费	每日按前一日基金资产净值计提/0.20%/每年	基金托管人
销售服务费C	C类基金份额的销售服务费年费率为0.50%/每年	销售机构
审计费用	30,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	规定披露报刊
其他	《基金合同》生效后与基金相关的律师费、诉讼费/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	1.97%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次的基金年报披露的相关数据为基准测算。

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仔细认真阅读本基金的《招募说明书》、《基金合同》、基金产品资料概要等信息披露文件，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本基金投资于证券市场，基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特有风险等其他风险。本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期

风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。具体内容详见本基金《招募说明书》“风险揭示”章节。

本基金可投资于资产支持证券，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。

本基金可投资于科创板股票，可能面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制（以下简称“港股通机制”）允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股交易失败风险（港股通业务试点期间存在每日额度限制，本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险）、港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股通标的股票不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险请查阅本基金《招募说明书》的“风险揭示”章节的具体内容。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

本基金可投资于股指期货、国债期货，可能面临的风险包括市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险、操作风险等。

本基金可投资于股票期权，股票期权价格主要受到标的资产价格水平、标的资产价格波动率、期权到期时间、市场利率水平等因素的影响。因此，投资股票期权主要存在Delta风险、Gamma风险、Vega风险、Theta风险以及Rho风险。同时，进行股票期权投资还面临流动性风险、信用风险、操作风险等。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见《基金合同》和《招募说明书》的相关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购、赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

（二）重要提示

格林宏观回报混合型证券投资基金经中国证监会2023年11月2日证监许可〔2023〕2466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。

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】【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