

格林日鑫月熠货币市场基金

2019 年第 3 季度报告

2019 年 09 月 30 日

基金管理人:格林基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期:2019 年 10 月 24 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	6
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	6
4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明	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	8
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 报告期债券回购融资情况	9
5.3 基金投资组合平均剩余期限	9
5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	10
5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	10
5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	11
5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	11
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	12
5.9 投资组合报告附注	12
§6 开放式基金份额变动	15
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	16
§8 影响投资者决策的其他重要信息	16
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	16
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	16
§9 备查文件目录	16
9.1 备查文件目录	16
9.2 存放地点	17
9.3 查阅方式	17

§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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年10月23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2019年7月1日起至2019年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	格林货币
基金主代码	004865
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年07月20日
报告期末基金份额总额	742,070,221.97份
投资目标	在严格控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	以保证资产的安全性和流动性为基本原则，力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变动等因素充分评估的基础上，科学预计未来利率走势，择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具，进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型

	基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	格林基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	格林货币A	格林货币B
下属分级基金的交易代码	004865	004866
报告期末下属分级基金的份额总额	15,920,713.90份	726,149,508.07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(2019年07月01日 - 2019年09月30日)	
	格林货币A	格林货币B
1.本期已实现收益	112,205.90	3,132,762.04
2.本期利润	112,205.90	3,132,762.04
3.期末基金资产净值	15,920,713.90	726,149,508.07

注：1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

格林货币A净值表现

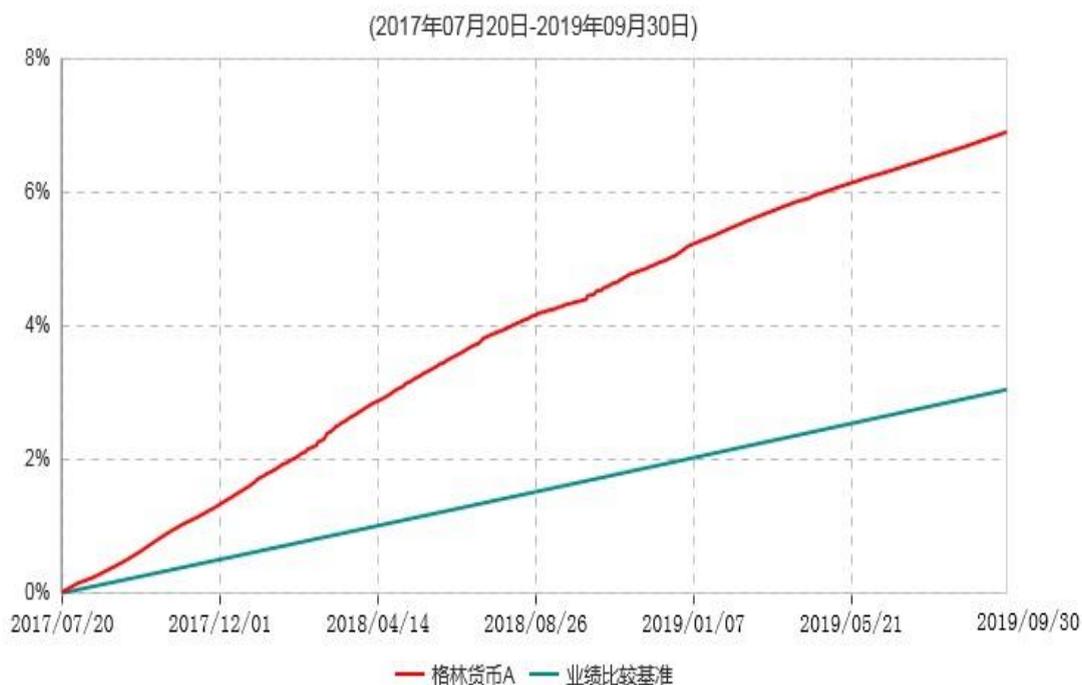
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5102%	0.0005%	0.3456%	0.0000%	0.1646%	0.0005%

格林货币B净值表现

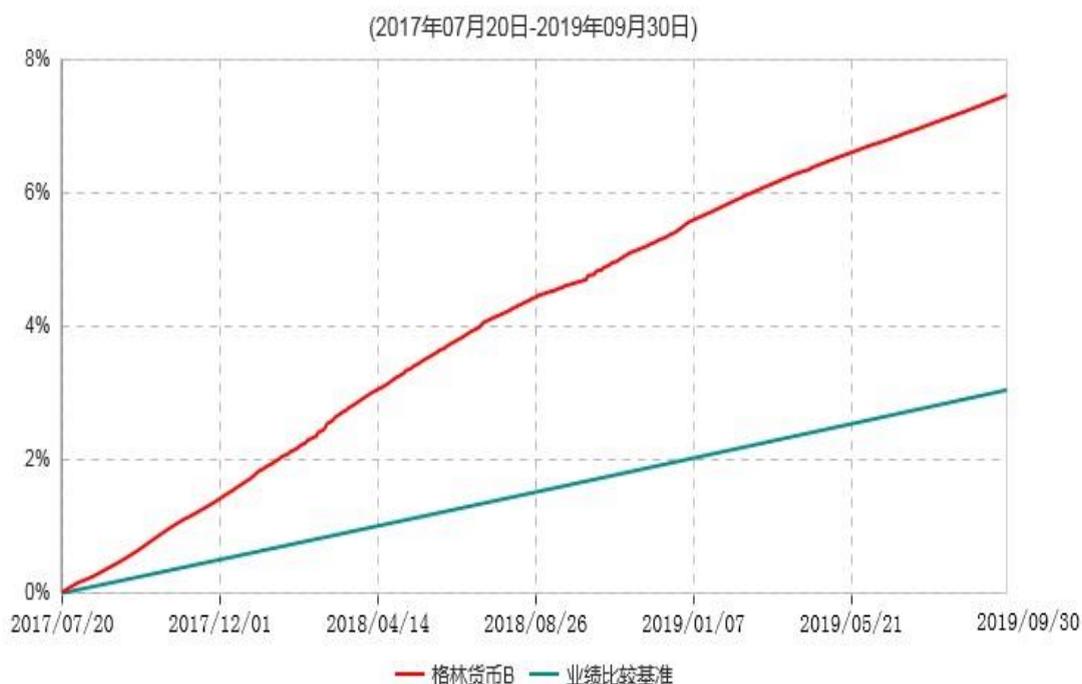
阶段	净值 收益率①	净值收益 率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5734%	0.0005%	0.3456%	0.0000%	0.2278%	0.0005%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

格林货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



格林货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§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
		任职日期	离任日期		
曹晋文	本基金基金经理、格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2017-07-26	2019-08-30	12	曹晋文先生，中国人民大学统计学硕士，获得注册会计师资格证书。先后就职于中国人寿资产、信诚人寿保险、民生加银基金。现任格林基金固定收益部总监，投资决策委员会委员。
宋东旭	本基金基金经理、格林伯元灵活配置混合型证券投资基金基金经理、格林泓鑫纯债债券型证券投资基金基金经理、格林	2017-07-20	-	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

	泓泰三个月定期 开放债券型证券 投资基金基金经 理				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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》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 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

2019年第三季度，全球主要国家表现持续低迷，悲观情绪持续，各国普遍进入降息周期，全球负收益率国债规模不断上升。国内宏观经济依旧处于下行探底阶段，供需两弱格局未改，房地产投资目前仍有韧性，但是在“房住不炒”“不再将房地产作为短期刺激经济的手段”的政策环境下，房地产将面临下行压力。政府为对冲经济下行压力，加大了逆周期调控政策，加快发行和使用地方政府专项债。目前基建虽有好转，但对经济的托底作用还未显现。

近期，债市面临的扰动因素较多，债市总体呈现震荡态势，包括美债利率反弹、8月CPI加剧通胀担忧、8月金融数据超预期、年内专项债提前发行概率增大、中美贸易谈判出现进展、资金面季节性紧张等因素，10年期国债收益率自7月初的3.2%下行至8月30日的3.0%，之后反弹至3.1%。

组合操作上，本报告期内本基金主要投资于同业存单、存款和回购，同时在季末增加了短融及逆回购的配置，组合久期平均维持在中高水平。展望四季度，全球经济增长乏力，国内经济基本面下行压力加大，债市面临扰动较多，包括中美贸易谈判进展、地方债发行、房地产数据、CPI上行、地方专项债提前发行等。下一阶段，本基金仍将继续做好流动性管理工作，结合基金管理人市场的判断，优化组合结构，把握货币市场价格波动节奏，提升组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末格林货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内该类基金份额净值收益率为0.5102%，同期业绩比较基准收益率为0.3456%；截至报告期末格林货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内该类基金份额净值收益率为0.5734%，同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

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资产净值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	固定收益投资	487,865,680.65	65.72
	其中：债券	487,865,680.65	65.72
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	196,402,884.60	26.46
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	57,331,219.62	7.72
4	其他资产	792,983.68	0.11
5	合计	742,392,768.55	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	4.48
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	61.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.33	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	6.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	14.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.94	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期限超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	39,877,997.75	5.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,068,841.15	6.75
6	中期票据	-	-
7	同业存单	397,918,841.75	53.62
8	其他	-	-
9	合计	487,865,680.65	65.74
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111982226	19宁波银行CD129	500,000	49,961,304.58	6.73
2	111916188	19上海银行CD188	500,000	49,961,304.58	6.73
3	111916285	19上海银行CD285	500,000	49,690,454.93	6.70
4	111910068	19兴业银行CD068	500,000	49,433,534.84	6.66
5	111813158	18浙商银行CD158	300,000	29,899,852.64	4.03
6	199936	19贴现国债36	300,000	29,889,321.77	4.03
7	111915064	19民生银行CD064	300,000	29,655,368.67	4.00
8	111910124	19兴业银行CD124	300,000	29,599,860.96	3.99
9	071900068	19招商CP007BC	200,000	20,000,017.02	2.70
10	111982237	19中原银行CD199	200,000	19,985,408.61	2.69

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0373%
报告期内偏离度的最低值	0.0003%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0113%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价或折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

5.9.2 19宁波银行CD129（代码：111982226）为本基金前十大持仓债券之一。2018年11月19日，中国银行保险监督管理委员会温州监管分局对宁波银行温州分行通过票据清单式交易方式充当他行信贷资产非真实转移通道等违规行为，处以罚款70万元。2018年12月13日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行个人贷款资金违规流入房市、购买理财的违规行为，处以罚款20万元。2018年12月19日，中国银行保险监督管理委员会绍兴监管分局对宁波银行绍兴分行违规开展同业业务等违规行为，处以罚款95万元。2019年2月3日，中国银行保险监督管理委员会台州监管分局对宁波银行台州分行贷款用途管控不严、信贷资金违规流入股市的违规行为，处以罚款25万元。2019年3月3日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行违规将同业存款变为一般性存款的违规行为，处以罚款20万元。2019年6月28日，中国银行保险监督管理委员会宁波监管局对宁波银行违反信贷政策、违反房地产行业政策等违规行为处以罚款270万元，对销售行为不合规、双录管理不到位的违规行为处以罚款30万元，并责令对相关直接责任给予纪律处分。

19民生银行CD064（代码：111915064）为本基金前十大持仓债券之一。2018年11月9日，中国银行保险监督管理委员会对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，处以罚款200万元；对内控管理严重违反审慎经营规则、同业投资违规接受担保、为非保本理财产品提供保本承诺等违规行为，处以罚款3160万元。2018年12月

7日，中国人民银行重庆营业管理部对民生银行违反清算管理规定及银行卡收单业务管理规定的违规行为，给予警告，没收违法所得88304.80元，并处罚款500000元，合计处罚金额588304.80元。2019年3月1日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对民生银行北京分行流动资金贷款严重违反审慎经营规则的违规行为，责令改正，并处以80万元罚款。2019年4月2日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局对民生银行大连分行小微联保授信业务贷前调查不尽职的违规行为，处以罚款50万元；对民生银行贷后管理不到位、银行承兑汇票保证金来源审查不严格等违规行为，处以罚款50万元；对民生银行以贷收贷、掩盖资产真实质量等违规行为，处以罚款100万元；对民生银行大连分行部分信贷资金回流本行作银行承兑汇票保证金等违规行为，处以罚款50万元；对民生银行贷后管理不到位等违规行为，处以罚款100万元。2019年7月17日，国家外汇管理局黑龙江省分局对民生银行哈尔滨分行为企业办理内保外贷业务未做到尽职审查的违规行为，没收违法所得285,484.50元人民币，并处以90万元人民币的罚款；对为企业办理货物贸易退汇收入未入待核查账户的违规行为，给予警告，并处以7万元人民币的罚款。

19上海银行CD188(代码 :111916188)、19上海银行CD285(代码 :111916285)为本基金前十大持仓债券之二。2019年9月16日，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局对上海银行南京分行采用不正当手段吸收存款的违规行为，处以罚款55万元。2019年8月15日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行市北分行授信管理严重不审慎等违规行为，责令改正，并处以罚款250万元。2019年8月12日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行浦东分行违规滚动签发部分银行承兑汇票，虚增资产负债规模等违规行为，责令改正，并处以罚款100万元。2019年3月20日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行静安支行未按规定进行贷款支付管理、未采取有效措施控制贷款资金使用的违规行为，责令改正，并处罚款共计100万元。2019年3月20日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行杨浦支行未采取有效方式对贷款资金使用情况进行跟踪检查的违规行为，责令改正，并处罚款50万元。2018年10月18日，中国银行业监督管理委员会上海监管局对上海银行对某同业资金违规投向资本金不足的房地产项目合规性审查未尽职的违规行为，责令改正，并处罚款50万元。2018年10月8日，中国银行业监督管理委员会上海监管局对上海银行违规向其关系人发放信用贷款的行为，责令改正，罚没合计1091460.03元。

19兴业银行CD068(代码 :111910068)、19兴业银行CD124(代码 :111910124)为本基金前十大持仓债券之二。2019年2月11日，中国银行保险监督管理委员会广东监

管局对兴业银行广州分行银行承兑业务严重违反审慎经营规则的违规行为，处以罚款50万元。2019年2月26日，中国银行保险监督管理委员会湖北监管局对兴业银行武汉分行贷款三查不尽职等违规行为，处以罚款130万元。2019年3月19日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局对兴业银行大连分行授信不审慎造成信用风险暴露的违规行为，处以罚款50万元。2019年3月25日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局对兴业银行北京安华支行流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，责令改正，并处以30万元罚款。2019年6月26日，中国银行保险监督管理委员会云南监管局对兴业银行昆明分行贷款用途审查、监控不力等违规行为，处以罚款30万元。2019年7月8日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行信用卡中心未遵守总授信额度管理制度等违规行为，责令整改，并处以罚款40万元。2019年7月29日，中国银行保险监督管理委员会福建监管局对兴业银行漳州分行同业投资业务内控管理不到位的违规行为，处以罚款100万元。2019年8月1日，中国银行保险监督管理委员会福建监管局对兴业银行莆田分行授信用于企业股本权益性投资和接受地方政府还款还息担保的违规行为，处以罚款50万元。2019年8月19日，中国银行间市场交易商协会对兴业银行作为北京粮食集团有限责任公司相关债务融资工具的主承销商，在债务融资工具存续期间未能对京粮集团资产无偿划转重大事项进行有效监测，及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露，也未及时召开持有人会议的违规行为，给予诫勉谈话处分，并责令整改。2019年9月3日，中国人民银行北京营业管理部对兴业银行北京分行未按照规定履行客户身份识别义务、与身份不明的客户进行交易等违规行为，合计处以罚款145万元。

18浙商银行CD158（代码：111813158）为本基金前十大持仓债券之一。2018年11月9日，中国银行保险监督管理委员会对浙商银行投资同业理财产品未尽职审查、个人理财资金违规投资、为非保本理财产品提供保本承诺等违规行为，处以罚款5550万元。

19招商CP007BC（代码：071900068）为本基金前十大持仓债券之一。2019年5月27日，香港证券及期货事务监察委员会对招商证券全资子公司招商证券（香港）有限公司在担任中国金属再生资源（控股）有限公司上市申请的联席保荐人时没有履行其应尽的尽职审查责任的行为，采取纪律行动，并处以罚款2,700万元港币。2019年5月30日，香港证券及期货事务监察委员会对招商证券全资子公司招商证券（香港）有限公司错误处理客户款项的行为，处以罚款500万元港币。

19中原银行CD199（代码：111982237）为本基金前十大持仓债券之一。2018年12月19日，中国银行保险监督管理委员会鹤壁银监分局对中原银行鹤壁分行违规办理信贷、票据业务的违规行为，处以罚款45万元。2018年12月20日，中国银行保险监督管

理委员会南阳银监分局对中原银行南阳分行以贷转存的违规行为，处以罚款20万元。2018年12月25日，中国银行保险监督管理委员会焦作银监分局对中原银行焦作分行延时支付吸存等违规行为，处以罚款20万元。2019年4月18日，中国银行保险监督管理委员会驻马店银保监分局对中原银行驻马店分行贷款三查严重不尽职、违规办理票据业务的违规行为，处以罚款30万元。

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，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期存在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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,260.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	788,718.35
4	应收申购款	1,004.66
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	792,983.68

5.9.4 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

	格林货币A	格林货币B
报告期期初基金份额总额	127,300,357.32	989,145,664.67
报告期期间基金总申购份额	21,137,529.44	1,068,162,062.04
报告期期间基金总赎回份额	132,517,172.86	1,331,158,218.64
报告期期末基金份额总额	15,920,713.90	726,149,508.07

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交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2019-07-15	-2,200,000.00	-2,200,000.00	0.00
2	赎回	2019-07-24	-1,100,000.00	-1,100,000.00	0.00
3	赎回	2019-08-14	-1,300,000.00	-1,300,000.00	0.00
4	赎回	2019-08-15	-1,000,000.00	-1,000,000.00	0.00
5	赎回	2019-08-23	-1,500,000.00	-1,500,000.00	0.00
6	赎回	2019-09-17	-1,200,000.00	-1,200,000.00	0.00
7	赎回	2019-09-24	-2,200,000.00	-2,200,000.00	0.00
8	红利再投	2019-09-30	42,646.23	42,646.23	0.00
合计			-10,457,353.77	-10,457,353.77	

注：本基金的收益分配按日结转份额，列示在“分红再投”项下一并披露。

§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日鑫月熠货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《格林日鑫月熠货币市场基金基金合同》；
- 3、《格林日鑫月熠货币市场基金托管协议》；
- 4、《格林日鑫月熠货币市场基金招募说明书》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和/或基金托管人的住所。

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

2019年10月24日